

中金中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	103
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.....	103
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.....	104

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	104
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	104
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	104
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	104
8.12	投资组合报告附注	104
§9	基金份额持有人信息	106
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	106
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	106
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	106
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	107
§10	开放式基金份额变动	108
§11	重大事件揭示	109
11.1	基金份额持有人大会决议	109
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	109
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	109
11.4	基金投资策略的改变	109
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	109
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	110
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	110
11.8	其他重大事件	111
§12	影响投资者决策的其他重要信息	114
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	114
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	114
§13	备查文件目录	115
13.1	备查文件目录	115
13.2	存放地点	115
13.3	查阅方式	115

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 500	
基金主代码	003016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	99,966,388.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金中证 500A	中金中证 500C
下属分级基金的交易代码:	003016	003578
报告期末下属分级基金的份额总额	71,170,611.80 份	28,795,776.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

		贸三期 B 座 43 层
--	--	--------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2019 年		2018 年		2017 年	
	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C	中金中证 500A	中金中证 500C
本期 已实 现收 益	13,554,769. 17	3,966,128.2 4	-4,542,207. 24	-1,000,831. 36	608,224.85	53,744.1 3
本期 利润	18,180,922. 40	4,087,244.6 0	-5,987,463. 18	-1,106,822. 86	752,397.25	28,629.9 0
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.2538	0.1948	-0.3030	-0.3069	0.0684	0.0707
本期 加权 平均 净值 利润 率	25.45%	19.20%	-31.38%	-32.52%	6.50%	6.48%
本期	33.75%	32.83%	-25.69%	-25.62%	6.79%	7.64%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末 可供 分配 利润	6,250,826.0 9	2,579,784.3 3	-5,748,514. 36	-1,245,040. 26	1,249,313.5 5	87,529.6 3
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.0878	0.0896	-0.1867	-0.1797	0.0945	0.1029
期末 基金 资产 净值	77,421,437. 89	31,375,561. 08	25,040,009. 91	5,681,686.3 3	14,467,345. 35	938,284. 63
期末 基金 份额 净值	1.0878	1.0896	0.8133	0.8203	1.0945	1.1029
3.1. 3	2019 年末		2018 年末		2017 年末	

累计 期末 指标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	8.78%	0.92%	-18.67%	-24.03%	9.45%	2.15%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 500A

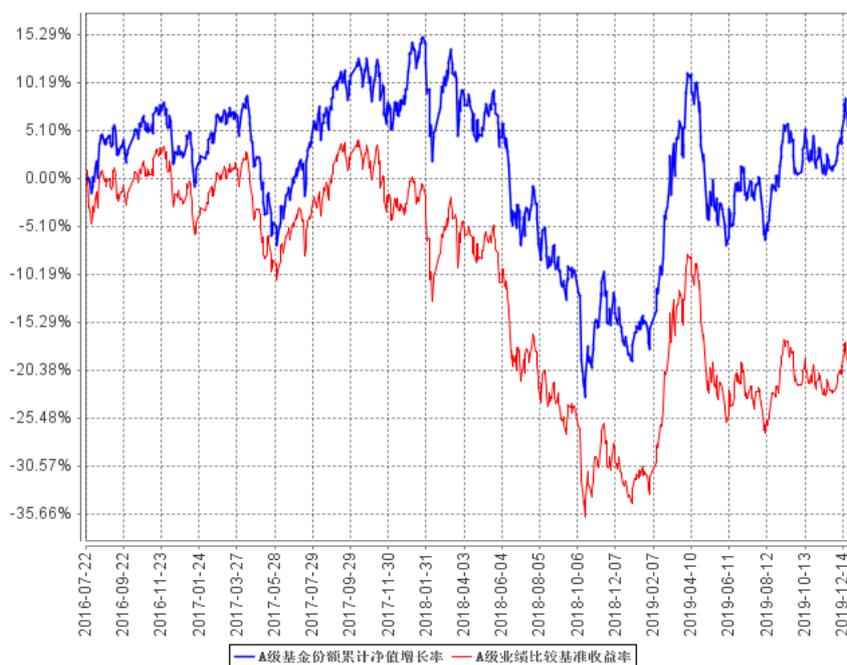
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.44%	0.88%	6.29%	0.88%	2.15%	0.00%
过去六个月	10.32%	0.98%	6.12%	1.03%	4.20%	-0.05%
过去一年	33.75%	1.30%	25.09%	1.39%	8.66%	-0.09%
过去三年	6.14%	1.23%	-14.86%	1.26%	21.00%	-0.03%
自基金合同生效起至今	8.78%	1.18%	-17.08%	1.22%	25.86%	-0.04%

中金中证 500C

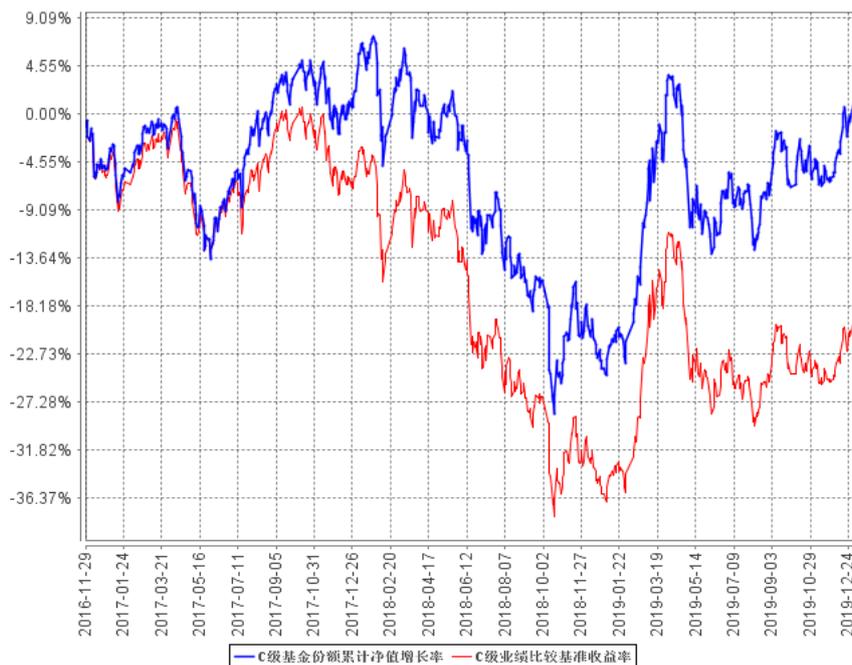
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.33%	0.88%	6.29%	0.88%	2.04%	0.00%
过去六个月	9.66%	0.98%	6.12%	1.03%	3.54%	-0.05%
过去一年	32.83%	1.30%	25.09%	1.39%	7.74%	-0.09%
过去三年	6.34%	1.23%	-14.86%	1.26%	21.20%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.92%	1.22%	-17.08%	1.26%	18.00%	-0.04%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

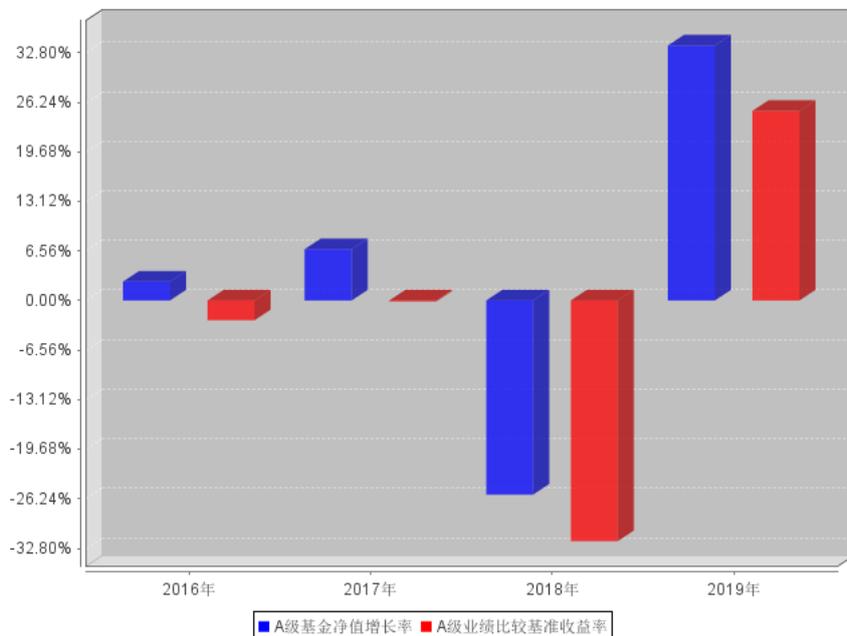


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

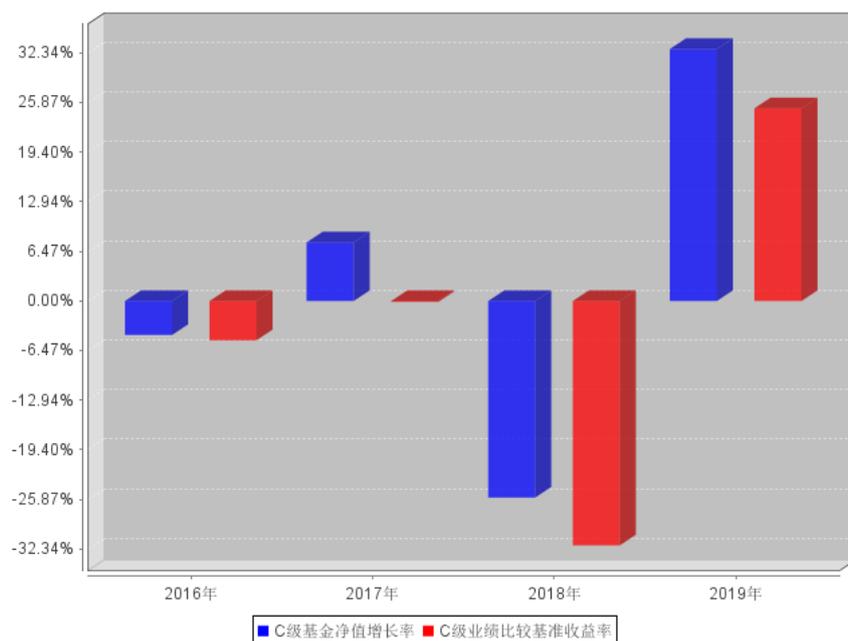


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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对比图



C级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对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）作为全资股东，是首家单一股东发起设立的基金公司，注册资本 4 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 28 只开放式基金，证券投资基金管理规模 237.84 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金的基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	9 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公募投资部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化模型进行选股来增强指数。2019 年全年，相对于业绩基准，获

取了一定的超额收益。我们将继续努力开发和改进选股模型，争取在超额收益方面有更好的表现。

2019 年底，中国经济平稳收官，A 股市场主要指数再度上涨。12 月全国制造业 PMI 为 50.2%，与 11 月持平，维持在年内次高点。12 月新订单指数微降至 51.2%，维持在线上并仍处年内高位，指向内需仍较平稳，12 月新出口订单指数反弹至 50.3%，创 18 年 6 月以来新高，外需有所走强。总的来看，12 月制造业 PMI 高位持平，延续了 11 月以来的扩张态势，且供需两端均较活跃，特别是外需和生产指标表现突出；四季度 PMI 均值也要高于二季度和三季度水平。全球不确定性高位回落，中美贸易摩擦阶段性缓和，第一阶段经贸协议文本达成一致。全球经济增长边际企稳，PMI 数据开始有所好转。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 500A 基金份额净值为 1.0878 元，本报告期基金份额净值增长率为 33.75%；截至本报告期末中金中证 500C 基金份额净值为 1.0896 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.83%；同期业绩比较基准收益率为 25.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，预计国内经济增速窄幅波动，大幅回升或者回落的可能性都不大，全年实际 GDP 增速稳定在 6.0%左右，名义 GDP 回升至 8%。2019 年第四季度开始的阶段性企稳延续至年中，下半年小幅回落的概率较大。货币政策显著收紧和大幅宽松的概率都不大。中美在贸易层面有望处于缓和期，特朗普在大选年有改善经济的主观诉求，贸易摩擦升级的可能性较小。但是 7 月民主党初选结束前后，大选形势将逐渐明朗，无论竞争对手是否有威胁，特朗普对中国的态度和策略都有可能转变，叠加第一阶段协议执行效果和第二阶段协议谈判进程未知，下半年中美关系的不确定性升高。

2020 年开年，新型冠状病毒疫情来袭。对照 2003 年“非典”对市场的影响，估计本次疫情对疫情当季及全年的业绩影响幅度会小于 2003 年。行业方面，第三产业如服务及消费类产业受影响较大，包括交通运输、酒店、旅游、传媒、零售等影响偏大，对其他制造类，如医药、汽车、科技硬件、电子、轻工等影响相对偏小，估计对在线消费类，如在线教育、视频、游戏等可能有一定的积极影响。目前 A 股市场整体估值处于历史中等偏低水平，如若市场出现较大回调，将提供低吸机会，关注中长期受益于消费升级和产业升级的龙头公司。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

- 1) 紧密跟踪并组织落实法律法规、自律规则及监管要求，不断完善基金运作管理内部制度建

设，促进依法合规展业；2) 研究、投资交易方面，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为 and 各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。3) 营销与销售方面，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。4) 基金运作保障方面，持续为注册登记、基金会计、资金清算等业务提供合规咨询，适时开展合规检查，为基金运营安全提供法律合规支持。5) 信息披露方面，严格落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，更新信息披露工作流程，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6) 以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，同时有重点地开展定期不定期的合规检查、内部稽核，促进公司合规运作。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2001649 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 37 页的中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“中金中证 500 指数增强基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中金中证 500 指数增强基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金中证 500 指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金中证 500 指数增强基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。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>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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</p>

	<p>或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金中证 500 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金中证 500 指数增强基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金中证 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>	
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金中证 500 指数增强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中金中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金中证 500 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>管祎铭</p>	<p>李瑞丛</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层</p>	
<p>审计报告日期</p>	<p>2020 年 4 月 15 日</p>	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,120,817.55	537,286.57
结算备付金		2,068,677.10	190,805.99
存出保证金		115,150.75	4,017.26
交易性金融资产	7.4.7.2	106,914,239.12	30,794,935.29
其中：股票投资		102,560,827.62	29,087,455.29
基金投资		-	-
债券投资		4,353,411.50	1,707,480.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		200,933.53	-
应收利息	7.4.7.5	58,621.26	47,741.77
应收股利		-	-
应收申购款		270,876.53	90,344.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		112,749,315.84	31,665,131.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		600,000.00	500,000.00
应付证券清算款		51,794.64	173,694.42
应付赎回款		1,987,570.80	57,775.92
应付管理人报酬		51,483.64	11,710.04
应付托管费		15,445.10	3,513.03
应付销售服务费		15,087.19	15,278.25
应付交易费用	7.4.7.7	1,180,603.52	120,600.10
应交税费		3.43	-
应付利息		-92.97	-139.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,421.52	61,003.23
负债合计		3,952,316.87	943,435.28
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	99,966,388.55	37,715,250.86
未分配利润	7.4.7.10	8,830,610.42	-6,993,554.62
所有者权益合计		108,796,998.97	30,721,696.24
负债和所有者权益总计		112,749,315.84	31,665,131.52

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，A 类基金净值人民币 1.0878 元，基金份额总额 71,170,611.80 份，C 类基金净值人民币 1.0896 元，基金份额总额 28,795,776.75 份，总份额合计 99,966,388.55 份。

7.2 利润表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		26,345,393.94	-6,459,758.38
1.利息收入		144,774.57	31,122.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	42,614.48	9,232.67
债券利息收入		102,160.09	21,841.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	48.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,774,157.05	-4,970,733.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,666,841.93	-5,260,745.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	38,138.27	-81.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	15,689.32	-
股利收益	7.4.7.16	1,053,487.53	290,093.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,747,269.59	-1,551,247.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	679,192.73	31,100.13
减：二、费用		4,077,226.94	634,527.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	455,919.18	112,292.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	136,775.67	33,687.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	84,862.95	13,532.66

4. 交易费用	7.4.7.19	3,285,695.61	408,123.68
5. 利息支出		47,141.08	2,446.71
其中：卖出回购金融资产支出		47,141.08	2,446.71
6. 税金及附加		57.37	-
7. 其他费用	7.4.7.20	66,775.08	64,444.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,268,167.00	-7,094,286.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,268,167.00	-7,094,286.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	37,715,250.86	-6,993,554.62	30,721,696.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,268,167.00	22,268,167.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	62,251,137.69	-6,444,001.96	55,807,135.73
其中：1. 基金申购款	293,068,189.26	-126,071.26	292,942,118.00

2. 基金赎回款	-230,817,051.57	-6,317,930.70	-237,134,982.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	99,966,388.55	8,830,610.42	108,796,998.97
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,068,786.80	1,336,843.18	15,405,629.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,094,286.04	-7,094,286.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	23,646,464.06	-1,236,111.76	22,410,352.30
其中：1. 基金申购款	32,904,038.15	-1,388,930.14	31,515,108.01
2. 基金赎回款	-9,257,574.09	152,818.38	-9,104,755.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	37,715,250.86	-6,993,554.62	30,721,696.24

注：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：

_____ 孙菁 _____	_____ 张纳 _____	_____ 白娜 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）及中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）公开发售，募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案，《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,000.00 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，

本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

2、应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

1、收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

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

1、所转移金融资产的账面价值

2、因转移而收到的对价

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 1、本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 2、本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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

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

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后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；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期末发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期末发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期末发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所

于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	3,120,817.55	537,286.57
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,120,817.55	537,286.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	99,486,585.97	102,560,827.62	3,074,241.65
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,314,382.20	4,353,411.50
	银行间市场	-	-
	合计	4,314,382.20	4,353,411.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	103,800,968.17	106,914,239.12	3,113,270.95
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		30,718,953.93	29,087,455.29	-1,631,498.64
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,709,980.00	1,707,480.00	-2,500.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,709,980.00	1,707,480.00	-2,500.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		32,428,933.93	30,794,935.29	-1,633,998.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	825.66	110.51
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	842.71	94.49
应收债券利息	56,895.91	47,534.79

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	56.98	1.98
合计	58,621.26	47,741.77

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,180,603.52	120,600.10
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,180,603.52	120,600.10

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	421.52	13.01
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	40,000.00	60,000.00
指数使用费	10,000.00	990.22
合计	50,421.52	61,003.23

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 500A		
项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,788,524.27	30,788,524.27
本期申购	218,414,307.03	218,414,307.03
本期赎回（以“-”号填列）	-178,032,219.50	-178,032,219.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	71,170,611.80	71,170,611.80

金额单位：人民币元

中金中证 500C		
项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,926,726.59	6,926,726.59
本期申购	74,653,882.23	74,653,882.23
本期赎回（以“-”号填列）	-52,784,832.07	-52,784,832.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	28,795,776.75	28,795,776.75

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 500A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,423,156.53	-2,325,357.83	-5,748,514.36
本期利润	13,554,769.17	4,626,153.23	18,180,922.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,058,226.97	-5,123,354.98	-6,181,581.95
其中：基金申购款	8,000,846.39	-9,551,310.76	-1,550,464.37
基金赎回款	-9,059,073.36	4,427,955.78	-4,631,117.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,073,385.67	-2,822,559.58	6,250,826.09

单位：人民币元

中金中证 500C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-717,053.93	-527,986.33	-1,245,040.26
本期利润	3,966,128.24	121,116.36	4,087,244.60
本期基金份额交易产生的变动数	484,956.72	-747,376.73	-262,420.01
其中：基金申购款	4,182,477.26	-2,758,084.15	1,424,393.11
基金赎回款	-3,697,520.54	2,010,707.42	-1,686,813.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,734,031.03	-1,154,246.70	2,579,784.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	23,556.93	6,857.95

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,361.41	2,275.10
其他	696.14	99.62
合计	42,614.48	9,232.67

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
卖出股票成交总额	1,224,527,520.78	147,884,545.17
减：卖出股票成本总额	1,204,860,678.85	153,145,290.36
买卖股票差价收入	19,666,841.93	-5,260,745.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	38,138.27	-81.51
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	38,138.27	-81.51

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	9,964,293.05	737,392.63
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	9,724,233.23	714,157.70
减：应收利息总额	201,921.55	23,316.44
买卖债券差价收入	38,138.27	-81.51

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本期及上年度均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期及上年度均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本期及上年度均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本期及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年12月	上年度可比期间收益金额 2018年1月1日至2018年12月

	31 日	31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	16,160.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,053,487.53	290,093.50
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	1,053,487.53	290,093.50

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,747,269.59	-1,551,247.44
——股票投资	4,705,740.29	-1,548,007.60
——债券投资	41,529.30	-3,239.84
——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	4,747,269.59	-1,551,247.44

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	677,958.74	30,439.35
基金转换费收入	1,233.99	660.78
合计	679,192.73	31,100.13

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	3,285,647.40	408,123.68
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	48.21	-
合计	3,285,695.61	408,123.68

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年
----	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	10,000.00	30,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	23,712.58	3,593.31
汇划手续费	3,062.50	851.00
其他	-	-
合计	66,775.08	64,444.31

7.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	基金托管人
中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融（香港）有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中金公司	1,028,115,418.19	41.22%	-	-
中金财富证券	280,210,548.24	11.24%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中金公司	8,007,417.58	36.68%	-	-
中金财富证券	4,058,772.61	18.59%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金公司	136,600,000.00	33.40%	-	-
中金财富证券	84,700,000.00	20.71%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	751,862.56	41.22%	751,862.56	63.68%
中金财富证券	204,918.17	11.24%	128,372.82	10.87%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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

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

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

3、本基金在上年度没有应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	455,919.18	112,292.47
其中：支付销售机构的客户维护费	80,735.58	13,895.21

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	136,775.67	33,687.83

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
中金基金	-	4,079.58	4,079.58
中金公司	-	1,053.73	1,053.73
中金财富证券	-	9,163.77	9,163.77
合计	-	14,297.08	14,297.08
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 500A	中金中证 500C	合计
	中金基金	-	218.80
中金公司	-	67.12	67.12
中金财富证券	-	0.00	0.00
合计	-	285.92	285.92

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期及上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	1,014,198.78	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,014,198.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.4250%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	32.4796%	-
-------------------------	----------	---

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018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
中国工商银行	3,120,817.55	23,556.93	537,286.57	6,857.95

注：1、本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。
2、本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2019年12月31日的相关余额为人民币2,183,827.85元(2018年12月31日：人民币194,823.25元)。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期及上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

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

本基金在本期未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注

688181	八亿时空	2019年 12月27日	2020 年1月6日	新股未 上市	43.98	43.98	1,495	65,750.10	65,750.10	-
688081	兴图新科	2019年 12月26日	2020 年1月6日	新股未 上市	28.21	28.21	2,050	57,830.50	57,830.50	-
002973	侨银环保	2019年 12月27日	2020 年1月6日	新股未 上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688218	江苏北人	2019年 11月29日	2020 年6月11日	首发原 股东限 售股份	17.36	23.48	5,790	100,514.40	135,949.20	-
688268	华特气体	2019年 12月19日	2020 年6月29日	首发原 股东限 售股份	22.16	35.78	2,608	57,793.28	93,314.24	-
688399	硕世生物	2019年 11月27日	2020 年6月5日	首发原 股东限 售股份	46.78	54.51	2,290	107,126.20	124,827.90	-

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如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据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 2019 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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未进行银行间市场债券正回购交易。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2019 年 12 月 31 日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 600,000.00 元,已于 2020 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 / 或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2019 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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资（上年度末：同）。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	892,026.50	-
未评级	-	-
合计	892,026.50	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，针对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性风险预警及危机的处理、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性风险指标进行监控。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,120,817.55	-	-	-	3,120,817.55
结算备付金	1,702,565.31	-	-	366,111.79	2,068,677.10
存出保证金	115,150.75	-	-	-	115,150.75
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	102,560,827.62	102,560,827.62
交易性金融资产-债券投资	3,461,385.00	842,547.20	49,479.30	-	4,353,411.50
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	200,933.53	200,933.53

应收利息				58,621.26	58,621.26
应收股利				-	-
应收申购款				270,876.53	270,876.53
资产总计	8,399,918.61	842,547.20	49,479.30	103,457,370.73	112,749,315.84
负债					
卖出回购金融资产款	600,000.00				600,000.00
应付证券清算款				51,794.64	51,794.64
应付赎回款				1,987,570.80	1,987,570.80
应付管理人报酬				51,483.64	51,483.64
应付托管费				15,445.10	15,445.10
应付交易费用				1,180,603.52	1,180,603.52
应付销售服务费				15,087.19	15,087.19
应交税费				3.43	3.43
应付利息				-92.97	-92.97
其他负债				50,421.52	50,421.52
负债总计	600,000.00			3,352,316.87	3,952,316.87
利率敏感度缺口	7,799,918.61	842,547.20	49,479.30	100,105,053.86	108,796,998.97
上年度末 2018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	537,286.57				537,286.57
结算备付金	190,805.99				190,805.99
存出保证金	4,017.26				4,017.26
交易性金融资产-股票投资				29,087,455.29	29,087,455.29
交易性金融资产-债券投资	1,707,480.00				1,707,480.00
买入返售金融资产					
应收证券清算款					
应收利息				47,741.77	47,741.77
应收股利					
应收申购款				90,344.64	90,344.64
资产总计	2,439,589.82			29,225,541.70	31,665,131.52
负债					
卖出回购金融资产款	500,000.00				500,000.00
应付证券清算款				173,694.42	173,694.42
应付赎回款				57,775.92	57,775.92
应付管理人报酬				11,710.04	11,710.04
应付托管费				3,513.03	3,513.03
应付交易费用				120,600.10	120,600.10
应付销售服务费				15,278.25	15,278.25
应交税费					
应付利息				-139.71	-139.71
其他负债				61,003.23	61,003.23
负债总计	500,000.00			443,435.28	943,435.28

利率敏感度缺口	1,939,589.82	-	-	28,782,106.42	30,721,696.24
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	3,917.96	103.01
	市场利率上升 25 个基点	-3,917.96	-103.01

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018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	102,560,827.62	94.27	29,087,455.29	94.68
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,353,411.50	4.00	1,707,480.00	5.56
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	106,914,239.12	98.27	30,794,935.29	100.24

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（2019年12月 31日）	上年度末（2018年12月 31日）
	业绩比较基准上升5%	5,030,936.52	1,485,163.59
	业绩比较基准下降5%	-5,030,936.52	-1,485,163.59

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的金融工具

(a) 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值 计量资产	本期末（错误!未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	102,560,827.62	102,076,577.64	354,091.34	130,158.64
- 债券投资	4,353,411.50	892,026.50	3,461,385.00	-
持续以公允价值计量的 资产总额	106,914,239.12	102,968,604.14	3,815,476.34	130,158.64

持续的公允价值 计量资产	上年度末（错误!未找到引用源。12月31日）			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	29,087,455.29	29,066,225.29	21,230.00	-
- 债券投资	1,707,480.00	-	1,707,480.00	-
持续以公允价值计量的 资产总额	30,794,935.29	29,066,225.29	1,728,710.00	-

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 484,249.98 元（2018 年 12 月 31 日：21,230.00 元）。于 2019 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具在三个层次之间发生了转换，由第二层次转换为第一层次，账面价值为人民币 20,171.00 元（2018 年 12 月 31 日：零）。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。

(b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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（2018 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	102,560,827.62	90.96
	其中：股票	102,560,827.62	90.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,353,411.50	3.86
	其中：债券	4,353,411.50	3.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,189,494.65	4.60
8	其他各项资产	645,582.07	0.57
9	合计	112,749,315.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	37,012.00	0.03
B	采矿业	4,009,217.00	3.69
C	制造业	41,782,904.92	38.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,650,437.25	4.27
E	建筑业	3,313,484.00	3.05
F	批发和零售业	4,673,399.00	4.30
G	交通运输、仓储和邮政业	4,182,773.28	3.84
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,131,852.09	9.31
J	金融业	5,421,265.60	4.98
K	房地产业	5,815,099.00	5.34
L	租赁和商务服务业	2,957,346.00	2.72
M	科学研究和技术服务业	35,784.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,034,092.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	566,060.00	0.52
Q	卫生和社会工作	799,068.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	744,593.00	0.68
S	综合	1,030,029.87	0.95
	合计	91,184,417.01	83.81

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	208,788.00	0.19
B	采矿业	282,240.00	0.26
C	制造业	7,340,730.67	6.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	384,227.00	0.35
E	建筑业	177,551.00	0.16
F	批发和零售业	533,960.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	280,985.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,058,664.90	0.97

J	金融业	291,857.00	0.27
K	房地产业	387,662.00	0.36
L	租赁和商务服务业	115,532.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	104,793.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	31,506.04	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,304.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	163,610.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	11,376,410.61	10.46

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600643	爱建集团	184,400	1,770,240.00	1.63
2	000006	深振业 A	309,000	1,656,240.00	1.52
3	000997	新大陆	103,300	1,640,404.00	1.51
4	600062	华润双鹤	124,420	1,623,681.00	1.49
5	600557	康缘药业	108,055	1,592,730.70	1.46
6	601179	中国西电	418,500	1,523,340.00	1.40
7	601611	中国核建	207,600	1,480,188.00	1.36
8	000027	深圳能源	232,745	1,445,346.45	1.33
9	600717	天津港	225,176	1,414,105.28	1.30
10	600820	隧道股份	224,200	1,354,168.00	1.24

11	002028	思源电气	96,300	1,326,051.00	1.22
12	002048	宁波华翔	85,475	1,321,443.50	1.21
13	002384	东山精密	56,407	1,305,822.05	1.20
14	002463	沪电股份	58,300	1,294,843.00	1.19
15	601958	金钼股份	160,900	1,288,809.00	1.18
16	600486	扬农化工	17,626	1,209,672.38	1.11
17	002745	木林森	88,700	1,207,207.00	1.11
18	600901	江苏租赁	190,600	1,204,592.00	1.11
19	600143	金发科技	163,500	1,190,280.00	1.09
20	601717	郑煤机	183,000	1,184,010.00	1.09
21	600138	中青旅	92,400	1,164,240.00	1.07
22	300166	东方国信	88,901	1,155,713.00	1.06
23	600779	水井坊	22,200	1,148,850.00	1.06
24	603355	莱克电气	48,253	1,142,148.51	1.05
25	600329	中新药业	81,623	1,131,294.78	1.04
26	000988	华工科技	55,600	1,128,124.00	1.04
27	603444	吉比特	3,741	1,116,651.09	1.03
28	600718	东软集团	98,100	1,113,435.00	1.02
29	600064	南京高科	113,100	1,102,725.00	1.01
30	002180	纳思达	33,100	1,089,652.00	1.00
31	603858	步长制药	51,900	1,070,178.00	0.98
32	600728	佳都科技	113,100	1,060,878.00	0.98
33	002414	高德红外	49,877	1,047,417.00	0.96
34	000967	盈峰环境	167,600	1,034,092.00	0.95
35	600751	海航科技	352,900	1,033,997.00	0.95
36	600874	创业环保	141,900	1,020,261.00	0.94
37	002065	东华软件	96,000	990,720.00	0.91
38	600120	浙江东方	112,740	984,220.20	0.90

39	601326	秦港股份	303,800	969,122.00	0.89
40	600317	营口港	379,700	968,235.00	0.89
41	600729	重庆百货	32,000	955,200.00	0.88
42	601969	海南矿业	164,900	954,771.00	0.88
43	600664	哈药股份	242,800	920,212.00	0.85
44	600266	城建发展	113,600	920,160.00	0.85
45	600466	蓝光发展	123,800	912,406.00	0.84
46	002221	东华能源	116,100	900,936.00	0.83
47	601966	玲珑轮胎	39,100	896,563.00	0.82
48	600777	新潮能源	410,100	861,210.00	0.79
49	000877	天山股份	70,300	833,055.00	0.77
50	002444	巨星科技	77,320	830,416.80	0.76
51	300418	昆仑万维	47,800	800,650.00	0.74
52	002128	露天煤业	92,400	800,184.00	0.74
53	600060	海信视像	73,300	795,305.00	0.73
54	600917	重庆燃气	106,200	771,012.00	0.71
55	603198	迎驾贡酒	38,600	768,912.00	0.71
56	603882	金域医学	14,800	758,056.00	0.70
57	000078	海王生物	194,000	723,620.00	0.67
58	000543	皖能电力	149,300	692,752.00	0.64
59	002302	西部建设	60,400	681,916.00	0.63
60	000528	柳工	97,800	678,732.00	0.62
61	002174	游族网络	28,600	665,522.00	0.61
62	002690	美亚光电	16,900	660,790.00	0.61
63	000061	农产品	118,100	660,179.00	0.61
64	603766	隆鑫通用	174,600	651,258.00	0.60
65	600881	亚泰集团	192,000	612,480.00	0.56
66	600058	五矿发展	75,400	604,708.00	0.56

67	603377	东方时尚	31,000	566,060.00	0.52
68	300134	大富科技	35,800	552,036.00	0.51
69	300014	亿纬锂能	10,900	546,744.00	0.50
70	600415	小商品城	135,600	524,772.00	0.48
71	603712	七一二	21,500	519,870.00	0.48
72	002807	江阴银行	109,240	509,058.40	0.47
73	600410	华胜天成	49,300	508,283.00	0.47
74	000400	许继电气	46,600	501,882.00	0.46
75	002818	富森美	39,500	499,675.00	0.46
76	002004	华邦健康	97,900	483,626.00	0.44
77	000050	深天马 A	29,000	472,410.00	0.43
78	600132	重庆啤酒	8,900	462,444.00	0.43
79	600787	中储股份	87,500	455,875.00	0.42
80	000008	神州高铁	125,500	455,565.00	0.42
81	600584	长电科技	20,400	448,392.00	0.41
82	000066	中国长城	28,600	445,016.00	0.41
83	002244	滨江集团	90,100	443,292.00	0.41
84	000686	东北证券	46,800	435,240.00	0.40
85	002925	盈趣科技	9,800	430,710.00	0.40
86	300026	红日药业	119,500	419,445.00	0.39
87	601001	大同煤业	93,500	411,400.00	0.38
88	000937	冀中能源	104,800	383,568.00	0.35
89	300251	光线传媒	32,500	383,500.00	0.35
90	002375	亚厦股份	59,300	343,940.00	0.32
91	000060	中金岭南	79,900	343,570.00	0.32
92	600895	张江高科	21,500	329,165.00	0.30
93	600073	上海梅林	40,600	323,582.00	0.30
94	600745	闻泰科技	3,200	296,000.00	0.27

95	300383	光环新网	14,100	282,987.00	0.26
96	000883	湖北能源	64,600	269,382.00	0.25
97	000930	中粮生化	39,100	258,060.00	0.24
98	002831	裕同科技	9,300	246,915.00	0.23
99	600737	中粮糖业	28,800	243,648.00	0.22
100	002353	杰瑞股份	6,500	240,240.00	0.22
101	002371	北方华创	2,500	220,000.00	0.20
102	603983	丸美股份	3,600	216,108.00	0.20
103	600582	天地科技	66,200	211,178.00	0.19
104	600909	华安证券	27,600	201,480.00	0.19
105	002382	蓝帆医疗	16,100	195,454.00	0.18
106	601231	环旭电子	9,900	190,377.00	0.17
107	601975	招商南油	67,200	188,832.00	0.17
108	000009	中国宝安	27,273	168,819.87	0.16
109	002049	紫光国微	3,148	160,044.32	0.15
110	600908	无锡银行	28,600	158,730.00	0.15
111	600633	浙数文化	17,000	155,550.00	0.14
112	600435	北方导航	18,400	153,088.00	0.14
113	002250	联化科技	8,800	150,744.00	0.14
114	601098	中南传媒	12,200	145,668.00	0.13
115	000402	金融街	17,700	143,724.00	0.13
116	601615	明阳智能	11,200	137,760.00	0.13
117	600373	中文传媒	8,700	118,407.00	0.11
118	600536	中国软件	1,600	114,704.00	0.11
119	600748	上实发展	19,100	113,454.00	0.10
120	600167	联美控股	8,300	109,228.00	0.10
121	300058	蓝色光标	19,200	108,480.00	0.10
122	000519	中兵红箭	14,000	106,680.00	0.10

123	000025	特力 A	4,500	95,400.00	0.09
124	002152	广电运通	9,600	92,256.00	0.08
125	000598	兴蓉环境	19,800	91,674.00	0.08
126	300315	掌趣科技	14,600	90,082.00	0.08
127	300002	神州泰岳	26,600	86,716.00	0.08
128	002373	千方科技	4,800	86,592.00	0.08
129	600970	中材国际	12,400	86,428.00	0.08
130	000685	中山公用	10,220	84,212.80	0.08
131	603883	老百姓	1,300	83,304.00	0.08
132	603707	健友股份	2,000	82,960.00	0.08
133	002390	信邦制药	15,800	82,950.00	0.08
134	002268	卫士通	2,900	74,791.00	0.07
135	002273	水晶光电	4,600	74,336.00	0.07
136	600528	中铁工业	6,400	73,600.00	0.07
137	000563	陕国投 A	16,600	73,538.00	0.07
138	600428	中远海特	18,900	70,686.00	0.06
139	600694	大商股份	2,500	68,475.00	0.06
140	000848	承德露露	8,600	67,682.00	0.06
141	300316	晶盛机电	4,300	67,596.00	0.06
142	000690	宝新能源	11,500	64,975.00	0.06
143	600098	广州发展	9,900	64,746.00	0.06
144	600704	物产中大	12,100	63,525.00	0.06
145	000012	南玻 A	12,588	63,065.88	0.06
146	600348	阳泉煤业	11,400	63,042.00	0.06
147	002191	劲嘉股份	5,500	62,755.00	0.06
148	601811	新华文轩	4,600	60,674.00	0.06
149	601168	西部矿业	9,100	60,242.00	0.06
150	600580	卧龙电驱	5,000	60,100.00	0.06

151	000718	苏宁环球	15,700	59,974.00	0.06
152	600094	大名城	10,100	59,085.00	0.05
153	000028	国药一致	1,300	58,968.00	0.05
154	601000	唐山港	22,300	57,980.00	0.05
155	600350	山东高速	11,800	57,938.00	0.05
156	002242	九阳股份	2,300	57,868.00	0.05
157	002544	杰赛科技	3,900	53,118.00	0.05
158	600079	人福医药	3,900	52,689.00	0.05
159	600388	龙净环保	5,400	52,650.00	0.05
160	600869	智慧能源	10,700	52,430.00	0.05
161	002572	索菲亚	2,500	52,375.00	0.05
162	600739	辽宁成大	3,400	51,782.00	0.05
163	000090	天健集团	9,200	48,760.00	0.04
164	600597	光明乳业	3,800	48,222.00	0.04
165	603806	福斯特	990	48,114.00	0.04
166	603877	太平鸟	3,100	47,337.00	0.04
167	000983	西山煤电	7,700	47,201.00	0.04
168	000729	燕京啤酒	7,200	46,944.00	0.04
169	002603	以岭药业	3,600	44,748.00	0.04
170	000738	航发控制	3,400	44,438.00	0.04
171	002839	张家港行	7,100	42,174.00	0.04
172	603816	顾家家居	900	41,157.00	0.04
173	600763	通策医疗	400	41,012.00	0.04
174	300324	旋极信息	7,100	39,760.00	0.04
175	000537	广宇发展	4,900	38,073.00	0.03
176	600598	北大荒	3,800	37,012.00	0.03
177	600008	首创股份	11,200	36,848.00	0.03
178	600325	华发股份	4,700	36,801.00	0.03

179	600757	长江传媒	5,900	36,344.00	0.03
180	300012	华测检测	2,400	35,784.00	0.03
181	002416	爱施德	4,400	33,484.00	0.03
182	000878	云南铜业	2,400	32,784.00	0.03
183	000750	国海证券	5,500	29,370.00	0.03
184	000807	云铝股份	5,600	28,784.00	0.03
185	002434	万里扬	3,000	28,440.00	0.03
186	002368	太极股份	700	27,244.00	0.03
187	300253	卫宁健康	1,800	26,964.00	0.02
188	002093	国脉科技	2,600	20,956.00	0.02
189	600446	金证股份	900	18,522.00	0.02
190	300207	欣旺达	900	17,568.00	0.02
191	000766	通化金马	2,200	14,388.00	0.01
192	002129	中环股份	1,200	14,172.00	0.01
193	002423	中原特钢	1,300	12,623.00	0.01
194	600521	华海药业	700	12,082.00	0.01
195	300257	开山股份	900	9,792.00	0.01
196	300529	健帆生物	100	7,184.00	0.01
197	600765	中航重机	200	2,046.00	0.00
198	600996	贵广网络	200	1,610.00	0.00
199	601865	福莱特	100	1,213.00	0.00
200	600307	酒钢宏兴	100	206.00	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	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	2,030	157,791.90	0.15

2	603501	韦尔股份	1,100	157,740.00	0.14
3	603986	兆易创新	700	143,423.00	0.13
4	688218	江苏北人	5,790	135,949.20	0.12
5	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.11
6	603160	汇顶科技	600	123,780.00	0.11
7	603598	引力传媒	6,800	115,532.00	0.11
8	600510	黑牡丹	14,400	96,480.00	0.09
9	600449	宁夏建材	8,600	95,976.00	0.09
10	002105	信隆健康	16,100	94,990.00	0.09
11	002377	国创高新	22,900	94,806.00	0.09
12	000573	粤宏远 A	30,600	94,554.00	0.09
13	002841	视源股份	1,100	94,270.00	0.09
14	688268	华特气体	2,608	93,314.24	0.09
15	000019	深粮控股	15,200	92,416.00	0.08
16	603926	铁流股份	7,700	92,015.00	0.08
17	002869	金溢科技	1,400	91,462.00	0.08
18	600479	千金药业	10,400	91,208.00	0.08
19	300543	朗科智能	3,900	90,441.00	0.08
20	000985	大庆华科	5,500	90,420.00	0.08
21	000913	钱江摩托	8,200	90,282.00	0.08
22	603458	勘设股份	4,700	89,723.00	0.08
23	603020	爱普股份	10,900	89,598.00	0.08
24	600135	乐凯胶片	12,600	89,586.00	0.08
25	300129	泰胜风能	18,300	88,938.00	0.08
26	002928	华夏航空	7,300	88,914.00	0.08
27	601677	明泰铝业	7,700	88,781.00	0.08
28	000756	新华制药	11,800	88,736.00	0.08
29	002487	大金重工	16,300	88,672.00	0.08

30	002734	利民股份	6,400	88,576.00	0.08
31	002518	科士达	8,300	88,561.00	0.08
32	601918	新集能源	27,300	88,452.00	0.08
33	002457	青龙管业	10,900	88,399.00	0.08
34	002020	京新药业	8,200	88,068.00	0.08
35	000042	中洲控股	8,100	87,966.00	0.08
36	603100	川仪股份	9,900	87,912.00	0.08
37	600713	南京医药	18,700	87,516.00	0.08
38	603368	柳药股份	2,600	87,464.00	0.08
39	300693	盛弘股份	6,100	87,413.00	0.08
40	600731	湖南海利	12,100	87,362.00	0.08
41	300043	星辉娱乐	17,000	87,210.00	0.08
42	002360	同德化工	16,100	86,779.00	0.08
43	600846	同济科技	9,300	86,583.00	0.08
44	603309	维力医疗	5,900	86,494.00	0.08
45	603609	禾丰牧业	7,300	86,359.00	0.08
46	002262	恩华药业	7,400	86,062.00	0.08
47	000933	神火股份	15,700	86,036.00	0.08
48	600356	恒丰纸业	11,100	86,025.00	0.08
49	002111	威海广泰	5,500	86,020.00	0.08
50	603878	武进不锈	7,500	85,875.00	0.08
51	002606	大连电瓷	14,900	85,824.00	0.08
52	600693	东百集团	16,400	85,772.00	0.08
53	002732	燕塘乳业	3,900	85,722.00	0.08
54	002755	奥赛康	5,300	85,648.00	0.08
55	300209	天泽信息	6,000	85,620.00	0.08
56	002443	金洲管道	12,700	85,344.00	0.08
57	002533	金杯电工	17,000	85,340.00	0.08

58	300453	三鑫医疗	11,300	85,315.00	0.08
59	002649	博彦科技	8,600	85,312.00	0.08
60	000751	锌业股份	26,400	85,272.00	0.08
61	002521	齐峰新材	14,300	85,228.00	0.08
62	300625	三雄极光	5,200	84,864.00	0.08
63	603979	金诚信	9,500	84,835.00	0.08
64	600855	航天长峰	6,900	84,801.00	0.08
65	002845	同兴达	4,300	84,710.00	0.08
66	300130	新国都	4,800	84,624.00	0.08
67	300248	新开普	10,300	84,563.00	0.08
68	603977	国泰集团	10,300	84,563.00	0.08
69	300552	万集科技	1,000	84,400.00	0.08
70	300412	迦南科技	12,700	84,328.00	0.08
71	601163	三角轮胎	5,500	84,150.00	0.08
72	300440	运达科技	10,400	83,928.00	0.08
73	600382	广东明珠	12,000	83,880.00	0.08
74	600532	宏达矿业	22,200	83,694.00	0.08
75	603559	中通国脉	4,700	83,613.00	0.08
76	300092	科新机电	11,400	83,106.00	0.08
77	002929	润建通信	3,000	83,100.00	0.08
78	000576	广东甘化	10,900	82,949.00	0.08
79	600798	宁波海运	23,300	82,948.00	0.08
80	000966	长源电力	17,800	82,770.00	0.08
81	603365	水星家纺	5,400	82,728.00	0.08
82	603966	法兰泰克	8,000	82,560.00	0.08
83	000708	大冶特钢	3,600	82,548.00	0.08
84	002746	仙坛股份	5,300	82,521.00	0.08
85	002084	海鸥住工	12,700	82,423.00	0.08

86	000719	中原传媒	11,500	82,340.00	0.08
87	000419	通程控股	18,000	82,260.00	0.08
88	600035	楚天高速	24,100	82,181.00	0.08
89	300719	安达维尔	7,000	82,040.00	0.08
90	600995	文山电力	10,500	81,900.00	0.08
91	002299	圣农发展	3,400	81,872.00	0.08
92	002335	科华恒盛	5,000	81,350.00	0.07
93	002858	力盛赛车	5,400	81,270.00	0.07
94	603968	醋化股份	5,500	81,180.00	0.07
95	001896	豫能控股	22,800	81,168.00	0.07
96	000601	韶能股份	14,500	80,330.00	0.07
97	300417	南华仪器	1,900	80,085.00	0.07
98	300428	四通新材	5,500	77,330.00	0.07
99	002062	宏润建设	21,800	76,518.00	0.07
100	002913	奥士康	1,200	71,028.00	0.07
101	603380	易德龙	4,200	70,140.00	0.06
102	002922	伊戈尔	4,600	69,000.00	0.06
103	300660	江苏雷利	4,300	68,929.00	0.06
104	002315	焦点科技	3,600	68,832.00	0.06
105	600390	五矿资本	8,300	68,558.00	0.06
106	002318	久立特材	7,300	68,474.00	0.06
107	002876	三利谱	1,400	68,320.00	0.06
108	600318	新力金融	9,600	67,200.00	0.06
109	000567	海德股份	7,400	66,674.00	0.06
110	002130	沃尔核材	13,400	66,196.00	0.06
111	688181	八亿时空	1,495	65,750.10	0.06
112	603258	电魂网络	2,800	65,744.00	0.06
113	300613	富瀚微	400	64,872.00	0.06

114	002106	莱宝高科	6,600	62,766.00	0.06
115	000023	深天地 A	4,800	62,496.00	0.06
116	300491	通合科技	4,800	62,448.00	0.06
117	601108	财通证券	5,500	62,370.00	0.06
118	688081	兴图新科	2,050	57,830.50	0.05
119	601633	长城汽车	6,300	55,755.00	0.05
120	002403	爱仕达	6,500	55,250.00	0.05
121	300424	航新科技	3,300	52,833.00	0.05
122	002015	霞客环保	9,700	51,119.00	0.05
123	603208	江山欧派	1,000	50,960.00	0.05
124	002161	远望谷	5,200	49,296.00	0.05
125	300286	安科瑞	4,200	48,552.00	0.04
126	002714	牧原股份	500	44,395.00	0.04
127	300433	蓝思科技	2,800	38,696.00	0.04
128	002731	萃华珠宝	4,600	35,650.00	0.03
129	002938	鹏鼎控股	700	31,430.00	0.03
130	002916	深南电路	200	28,420.00	0.03
131	002045	国光电器	2,300	28,037.00	0.03
132	000888	峨眉山 A	3,800	24,928.00	0.02
133	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
134	300235	方直科技	1,500	20,580.00	0.02
135	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.02
136	600720	祁连山	1,400	17,570.00	0.02
137	600197	伊力特	1,000	16,030.00	0.01
138	603600	永艺股份	1,300	15,964.00	0.01
139	000529	广弘控股	2,300	15,755.00	0.01
140	603139	康惠制药	900	15,498.00	0.01
141	300443	金雷股份	1,100	15,389.00	0.01

142	300500	启迪设计	1,000	15,070.00	0.01
143	002641	永高股份	3,200	14,944.00	0.01
144	300569	天能重工	1,000	14,920.00	0.01
145	600513	联环药业	1,900	14,801.00	0.01
146	000705	浙江震元	2,200	14,652.00	0.01
147	000059	华锦股份	2,400	14,616.00	0.01
148	603315	福鞍股份	1,200	14,580.00	0.01
149	600496	精工钢构	5,000	14,450.00	0.01
150	603303	得邦照明	1,400	14,434.00	0.01
151	603227	雪峰科技	3,100	14,415.00	0.01
152	002607	中公教育	800	14,304.00	0.01
153	002022	科华生物	1,200	14,016.00	0.01
154	603801	志邦家居	600	13,974.00	0.01
155	000619	海螺型材	2,400	13,896.00	0.01
156	002016	世荣兆业	1,600	13,856.00	0.01
157	603577	汇金通	1,300	13,793.00	0.01
158	600020	中原高速	3,100	13,640.00	0.01
159	600761	安徽合力	1,400	13,622.00	0.01
160	300320	海达股份	2,800	13,608.00	0.01
161	002498	汉缆股份	4,500	13,545.00	0.01
162	300697	电工合金	900	13,545.00	0.01
163	002367	康力电梯	1,700	13,515.00	0.01
164	300016	北陆药业	1,500	13,485.00	0.01
165	002945	华林证券	900	13,446.00	0.01
166	600866	星湖科技	3,000	13,320.00	0.01
167	000099	中信海直	1,800	13,302.00	0.01
168	601898	中煤能源	2,600	13,052.00	0.01
169	300393	中来股份	900	13,041.00	0.01

170	601058	赛轮轮胎	2,900	12,963.00	0.01
171	600727	鲁北化工	1,800	12,762.00	0.01
172	300246	宝莱特	800	12,384.00	0.01
173	600508	上海能源	1,300	12,207.00	0.01
174	601878	浙商证券	800	8,904.00	0.01
175	000591	太阳能	1,800	6,588.00	0.01
176	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01
177	600183	生益科技	200	4,184.00	0.00
178	600061	国投资本	200	3,028.00	0.00
179	601698	中国卫通	200	2,264.00	0.00
180	601236	红塔证券	100	1,677.00	0.00
181	603013	亚普股份	100	1,536.00	0.00
182	300737	科顺股份	100	1,132.00	0.00
183	002182	云海金属	100	925.00	0.00
184	300231	银信科技	100	835.00	0.00
185	600780	通宝能源	100	352.00	0.00
186	000629	攀钢钒钛	100	292.00	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	603444	吉比特	8,715,381.89	28.37
2	600557	康缘药业	8,549,974.34	27.83
3	002028	思源电气	8,250,183.00	26.85
4	603355	莱克电气	8,032,445.36	26.15
5	601717	郑煤机	7,816,682.00	25.44

6	002048	宁波华翔	7,787,706.52	25.35
7	601966	玲珑轮胎	7,779,493.00	25.32
8	002444	巨星科技	7,589,702.00	24.70
9	600643	爱建集团	7,260,381.00	23.63
10	600993	马应龙	6,979,060.80	22.72
11	002128	露天煤业	6,938,332.00	22.58
12	000997	新大陆	6,937,978.00	22.58
13	600062	华润双鹤	6,931,281.53	22.56
14	600580	卧龙电驱	6,925,661.90	22.54
15	601958	金钼股份	6,915,086.00	22.51
16	600376	首开股份	6,854,615.80	22.31
17	000988	华工科技	6,794,337.00	22.12
18	002299	圣农发展	6,777,120.90	22.06
19	000528	柳工	6,629,002.70	21.58
20	000027	深圳能源	6,627,097.54	21.57
21	600143	金发科技	6,475,024.00	21.08
22	000877	天山股份	6,471,982.00	21.07
23	002439	启明星辰	6,433,693.85	20.94
24	601811	新华文轩	6,361,457.95	20.71
25	603556	海兴电力	6,277,238.60	20.43
26	002332	仙琚制药	6,217,485.98	20.24
27	601611	中国核建	6,127,767.00	19.95
28	603806	福斯特	6,063,666.00	19.74
29	600750	江中药业	5,972,229.79	19.44
30	002463	沪电股份	5,964,201.25	19.41
31	600466	蓝光发展	5,822,192.14	18.95
32	600633	浙数文化	5,711,952.33	18.59
33	600909	华安证券	5,677,346.00	18.48

34	600064	南京高科	5,663,212.33	18.43
35	000400	许继电气	5,611,483.74	18.27
36	600985	淮北矿业	5,611,392.00	18.27
37	000543	皖能电力	5,609,870.00	18.26
38	600267	海正药业	5,609,764.00	18.26
39	600266	北京城建	5,609,110.00	18.26
40	600329	中新药业	5,607,098.00	18.25
41	600779	水井坊	5,599,280.00	18.23
42	300166	东方国信	5,598,378.26	18.22
43	601928	凤凰传媒	5,553,371.00	18.08
44	600801	华新水泥	5,466,219.40	17.79
45	601179	中国西电	5,456,626.00	17.76
46	601311	骆驼股份	5,410,153.00	17.61
47	600565	迪马股份	5,395,891.00	17.56
48	002373	千方科技	5,369,082.48	17.48
49	600820	隧道股份	5,367,665.00	17.47
50	002745	木林森	5,336,736.00	17.37
51	000061	农产品	5,322,018.00	17.32
52	600718	东软集团	5,273,842.00	17.17
53	600901	江苏租赁	5,218,704.00	16.99
54	300418	昆仑万维	5,183,324.00	16.87
55	002250	联化科技	5,115,341.00	16.65
56	000729	燕京啤酒	5,109,890.97	16.63
57	002818	富森美	5,097,041.92	16.59
58	600348	阳泉煤业	5,002,502.00	16.28
59	600582	天地科技	4,938,185.00	16.07
60	601001	大同煤业	4,902,595.00	15.96
61	002414	高德红外	4,878,031.02	15.88

62	600777	新潮能源	4,785,571.00	15.58
63	600597	光明乳业	4,782,934.00	15.57
64	600694	大商股份	4,750,148.63	15.46
65	002317	众生药业	4,742,326.00	15.44
66	600751	海航科技	4,732,199.00	15.40
67	600138	中青旅	4,730,105.98	15.40
68	300088	长信科技	4,722,492.00	15.37
69	002152	广电运通	4,708,117.00	15.33
70	002489	浙江永强	4,693,616.00	15.28
71	002603	以岭药业	4,578,601.00	14.90
72	600717	天津港	4,550,844.00	14.81
73	600511	国药股份	4,550,151.00	14.81
74	600863	内蒙华电	4,543,956.00	14.79
75	600037	歌华有线	4,537,751.44	14.77
76	600765	中航重机	4,535,037.31	14.76
77	600317	营口港	4,525,176.00	14.73
78	000301	东方盛虹	4,516,149.00	14.70
79	600167	联美控股	4,510,179.70	14.68
80	000156	华数传媒	4,458,390.40	14.51
81	600970	中材国际	4,452,842.70	14.49
82	300058	蓝色光标	4,450,921.49	14.49
83	600486	扬农化工	4,445,027.94	14.47
84	002916	深南电路	4,441,347.20	14.46
85	600410	华胜天成	4,405,207.00	14.34
86	600120	浙江东方	4,396,761.36	14.31
87	600073	上海梅林	4,387,771.75	14.28
88	000983	西山煤电	4,358,918.00	14.19
89	300115	长盈精密	4,291,975.00	13.97

90	603198	迎驾贡酒	4,271,925.80	13.91
91	002375	亚厦股份	4,270,544.00	13.90
92	600183	生益科技	4,269,553.60	13.90
93	002690	美亚光电	4,187,184.00	13.63
94	002049	紫光国微	4,178,680.25	13.60
95	000009	中国宝安	4,164,598.72	13.56
96	002004	华邦健康	4,147,338.00	13.50
97	300315	掌趣科技	4,117,207.00	13.40
98	603883	老百姓	4,087,724.00	13.31
99	600971	恒源煤电	4,045,957.40	13.17
100	600917	重庆燃气	4,027,328.07	13.11
101	600171	上海贝岭	3,928,841.42	12.79
102	000008	神州高铁	3,906,367.36	12.72
103	000600	建投能源	3,881,673.00	12.63
104	600058	五矿发展	3,859,821.00	12.56
105	002607	中公教育	3,852,796.20	12.54
106	600026	中远海能	3,785,148.00	12.32
107	601118	海南橡胶	3,781,007.00	12.31
108	600757	长江传媒	3,777,273.00	12.30
109	600755	厦门国贸	3,770,534.00	12.27
110	600939	重庆建工	3,765,141.00	12.26
111	600754	锦江股份	3,752,960.00	12.22
112	000848	承德露露	3,752,831.00	12.22
113	000718	苏宁环球	3,721,240.12	12.11
114	600699	均胜电子	3,705,764.26	12.06
115	300026	红日药业	3,703,523.00	12.06
116	601168	西部矿业	3,675,752.00	11.96
117	600642	申能股份	3,675,423.78	11.96

118	600312	平高电气	3,674,097.00	11.96
119	600881	亚泰集团	3,664,936.00	11.93
120	600307	酒钢宏兴	3,637,643.00	11.84
121	002387	维信诺	3,629,201.00	11.81
122	000028	国药一致	3,573,882.00	11.63
123	002244	滨江集团	3,547,548.48	11.55
124	600729	重庆百货	3,546,511.22	11.54
125	002384	东山精密	3,540,367.99	11.52
126	600060	海信电器	3,514,988.00	11.44
127	000685	中山公用	3,497,517.80	11.38
128	002544	杰赛科技	3,492,377.00	11.37
129	002831	裕同科技	3,489,299.40	11.36
130	601098	中南传媒	3,479,177.68	11.32
131	600169	太原重工	3,479,039.00	11.32
132	601326	秦港股份	3,468,918.00	11.29
133	000999	华润三九	3,455,707.00	11.25
134	002174	游族网络	3,440,142.85	11.20
135	600373	中文传媒	3,435,352.00	11.18
136	300383	光环新网	3,386,712.00	11.02
137	600787	中储股份	3,379,615.00	11.00
138	601000	唐山港	3,325,147.40	10.82
139	600428	中远海特	3,299,903.00	10.74
140	002807	江阴银行	3,283,078.00	10.69
141	600862	中航高科	3,258,267.00	10.61
142	002251	步步高	3,255,889.00	10.60
143	603766	隆鑫通用	3,194,378.00	10.40
144	002191	劲嘉股份	3,190,657.08	10.39
145	601872	招商轮船	3,142,390.00	10.23

146	002635	安洁科技	3,122,096.85	10.16
147	600039	四川路桥	3,117,236.00	10.15
148	000012	南玻 A	3,051,662.10	9.93
149	000883	湖北能源	3,049,779.00	9.93
150	000006	深振业 A	3,047,501.59	9.92
151	002242	九阳股份	3,023,569.00	9.84
152	600053	九鼎投资	3,000,225.10	9.77
153	002353	杰瑞股份	2,989,757.37	9.73
154	000031	大悦城	2,980,398.85	9.70
155	600827	百联股份	2,939,758.00	9.57
156	000636	风华高科	2,934,336.00	9.55
157	601016	节能风电	2,912,673.00	9.48
158	002416	爱施德	2,911,493.40	9.48
159	600350	山东高速	2,902,472.00	9.45
160	600098	广州发展	2,901,099.00	9.44
161	601699	潞安环能	2,890,019.00	9.41
162	002195	二三四五	2,878,054.00	9.37
163	600008	首创股份	2,813,473.00	9.16
164	000623	吉林敖东	2,795,266.49	9.10
165	601333	广深铁路	2,750,762.00	8.95
166	600277	亿利洁能	2,723,998.00	8.87
167	601615	明阳智能	2,722,576.00	8.86
168	002399	海普瑞	2,718,111.00	8.85
169	000537	广宇发展	2,713,693.64	8.83
170	601969	海南矿业	2,705,894.00	8.81
171	002701	奥瑞金	2,696,069.00	8.78
172	600315	上海家化	2,690,416.00	8.76
173	000021	深科技	2,688,331.00	8.75

174	603939	益丰药房	2,687,365.00	8.75
175	000158	常山北明	2,680,009.70	8.72
176	600536	中国软件	2,663,085.83	8.67
177	002268	卫士通	2,659,815.00	8.66
178	603328	依顿电子	2,644,951.96	8.61
179	002273	水晶光电	2,623,866.55	8.54
180	600017	日照港	2,601,749.00	8.47
181	002302	西部建设	2,595,897.00	8.45
182	600745	闻泰科技	2,574,077.00	8.38
183	600823	世茂股份	2,569,042.92	8.36
184	600673	东阳光科	2,555,618.00	8.32
185	601100	恒立液压	2,546,249.40	8.29
186	600657	信达地产	2,544,544.00	8.28
187	600528	中铁工业	2,533,796.00	8.25
188	600611	大众交通	2,532,690.00	8.24
189	600575	皖江物流	2,465,839.00	8.03
190	002019	亿帆医药	2,424,224.00	7.89
191	603000	人民网	2,410,199.00	7.85
192	000930	中粮生化	2,409,422.00	7.84
193	000501	鄂武商 A	2,376,468.99	7.74
194	000060	中金岭南	2,343,629.00	7.63
195	000690	宝新能源	2,313,689.00	7.53
196	000066	中国长城	2,273,366.00	7.40
197	000598	兴蓉环境	2,269,550.00	7.39
198	601231	环旭电子	2,234,372.79	7.27
199	000513	丽珠集团	2,224,893.55	7.24
200	600874	创业环保	2,201,086.00	7.16
201	600739	辽宁成大	2,196,947.00	7.15

202	600584	长电科技	2,178,707.00	7.09
203	300459	金科文化	2,158,684.00	7.03
204	600125	铁龙物流	2,151,883.00	7.00
205	603233	大参林	2,149,568.50	7.00
206	600639	浦东金桥	2,149,371.00	7.00
207	601801	皖新传媒	2,147,149.00	6.99
208	000987	越秀金控	2,143,204.00	6.98
209	603712	七一二	2,127,041.00	6.92
210	002821	凯莱英	2,124,916.00	6.92
211	002344	海宁皮城	2,120,815.00	6.90
212	002221	东华能源	2,115,619.00	6.89
213	603858	步长制药	2,114,865.04	6.88
214	603377	东方时尚	2,101,049.00	6.84
215	002382	蓝帆医疗	2,088,231.00	6.80
216	600415	小商品城	2,083,768.00	6.78
217	600978	宜华生活	2,080,479.00	6.77
218	300207	欣旺达	2,071,918.00	6.74
219	600151	航天机电	2,068,234.94	6.73
220	002280	联络互动	2,065,232.00	6.72
221	600021	上海电力	2,062,303.00	6.71
222	600908	无锡银行	2,060,486.00	6.71
223	600664	哈药股份	2,059,247.00	6.70
224	002926	华西证券	2,044,954.00	6.66
225	000926	福星股份	1,997,147.00	6.50
226	600869	智慧能源	1,995,775.00	6.50
227	603877	太平鸟	1,981,905.61	6.45
228	600499	科达洁能	1,981,259.00	6.45
229	600388	龙净环保	1,973,827.00	6.42

230	002572	索菲亚	1,970,526.00	6.41
231	600563	法拉电子	1,963,499.00	6.39
232	600648	外高桥	1,953,037.00	6.36
233	002707	众信旅游	1,938,635.00	6.31
234	603501	韦尔股份	1,935,526.00	6.30
235	300257	开山股份	1,882,927.00	6.13
236	000878	云南铜业	1,874,595.00	6.10
237	600903	贵州燃气	1,859,880.60	6.05
238	300134	大富科技	1,831,642.00	5.96
239	002249	大洋电机	1,811,404.00	5.90
240	600728	佳都科技	1,771,154.07	5.77
241	601005	重庆钢铁	1,745,802.00	5.68
242	002233	塔牌集团	1,735,321.00	5.65
243	000541	佛山照明	1,708,865.40	5.56
244	300002	神州泰岳	1,703,581.00	5.55
245	300010	立思辰	1,637,679.00	5.33
246	600079	人福医药	1,636,224.00	5.33
247	300055	万邦达	1,634,209.00	5.32
248	002180	纳思达	1,608,616.00	5.24
249	000401	冀东水泥	1,591,689.62	5.18
250	002512	达华智能	1,563,830.00	5.09
251	000937	冀中能源	1,550,019.00	5.05
252	000552	靖远煤电	1,535,798.00	5.00
253	000829	天音控股	1,518,677.00	4.94
254	603056	德邦股份	1,492,171.00	4.86
255	600418	江淮汽车	1,487,494.00	4.84
256	603568	伟明环保	1,481,767.00	4.82
257	000049	德赛电池	1,469,292.00	4.78

258	002405	四维图新	1,466,150.00	4.77
259	000738	航发控制	1,441,058.00	4.69
260	002812	恩捷股份	1,429,565.00	4.65
261	000967	盈峰环境	1,410,871.00	4.59
262	002465	海格通信	1,401,127.00	4.56
263	600380	健康元	1,387,656.00	4.52
264	000078	海王生物	1,383,577.00	4.50
265	000090	天健集团	1,382,670.00	4.50
266	600335	国机汽车	1,377,468.00	4.48
267	601866	中远海发	1,377,041.00	4.48
268	601608	中信重工	1,373,607.00	4.47
269	600056	中国医药	1,372,421.00	4.47
270	002065	东华软件	1,360,051.76	4.43
271	002340	格林美	1,357,730.00	4.42
272	002223	鱼跃医疗	1,351,164.00	4.40
273	601019	山东出版	1,350,379.00	4.40
274	300014	亿纬锂能	1,339,533.60	4.36
275	600707	彩虹股份	1,326,888.00	4.32
276	002372	伟星新材	1,322,416.23	4.30
277	002500	山西证券	1,317,115.00	4.29
278	600435	北方导航	1,315,725.00	4.28
279	300316	晶盛机电	1,294,679.00	4.21
280	002074	国轩高科	1,283,406.00	4.18
281	603882	金域医学	1,283,003.00	4.18
282	600521	华海药业	1,235,822.60	4.02
283	600763	通策医疗	1,204,876.00	3.92
284	600748	上实发展	1,182,256.00	3.85
285	002266	浙富控股	1,170,370.00	3.81

286	000869	张裕 A	1,164,840.00	3.79
287	603515	欧普照明	1,155,844.00	3.76
288	601799	星宇股份	1,155,586.00	3.76
289	300009	安科生物	1,148,501.00	3.74
290	002318	久立特材	1,144,987.00	3.73
291	002440	闰土股份	1,135,528.00	3.70
292	002371	北方华创	1,135,450.00	3.70
293	600500	中化国际	1,122,670.40	3.65
294	002936	郑州银行	1,112,028.00	3.62
295	002946	新乳业	1,108,778.00	3.61
296	002925	盈趣科技	1,107,943.00	3.61
297	600570	恒生电子	1,097,462.00	3.57
298	300244	迪安诊断	1,087,601.00	3.54
299	600316	洪都航空	1,085,982.00	3.53
300	000960	锡业股份	1,075,862.00	3.50
301	002056	横店东磁	1,072,016.00	3.49
302	300251	光线传媒	1,068,840.00	3.48
303	600859	王府井	1,068,485.00	3.48
304	000059	华锦股份	1,065,968.00	3.47
305	002437	誉衡药业	1,047,964.00	3.41
306	000596	古井贡酒	1,042,619.00	3.39
307	603650	彤程新材	1,030,592.00	3.35
308	000686	东北证券	1,028,776.00	3.35
309	601106	中国一重	1,005,767.00	3.27
310	002641	永高股份	988,410.00	3.22
311	000750	国海证券	986,028.00	3.21
312	600737	中粮糖业	980,134.84	3.19
313	002672	东江环保	973,166.86	3.17

314	002129	中环股份	939,466.00	3.06
315	603866	桃李面包	939,314.00	3.06
316	600132	重庆啤酒	933,921.00	3.04
317	600848	上海临港	926,490.08	3.02
318	002127	南极电商	916,090.00	2.98
319	002020	京新药业	914,738.00	2.98
320	600770	综艺股份	911,221.00	2.97
321	600727	鲁北化工	902,520.00	2.94
322	002948	青岛银行	899,801.52	2.93
323	000025	特力 A	899,307.00	2.93
324	600325	华发股份	892,470.07	2.91
325	601689	拓普集团	891,255.00	2.90
326	600216	浙江医药	882,870.91	2.87
327	600393	粤泰股份	875,708.00	2.85
328	000519	中兵红箭	873,694.00	2.84
329	002345	潮宏基	868,824.80	2.83
330	002563	森马服饰	867,300.00	2.82
331	601200	上海环境	855,262.03	2.78
332	600496	精工钢构	836,535.00	2.72
333	002277	友阿股份	831,522.00	2.71
334	300569	天能重工	829,841.00	2.70
335	300017	网宿科技	829,140.00	2.70
336	002482	广田集团	826,180.00	2.69
337	600258	首旅酒店	821,724.00	2.67
338	603369	今世缘	818,475.00	2.66
339	002368	太极股份	818,345.00	2.66
340	600895	张江高科	815,281.00	2.65
341	600845	宝信软件	814,199.00	2.65

342	002276	万马股份	812,765.00	2.65
343	002254	泰和新材	806,348.00	2.62
344	000023	深天地 A	805,627.00	2.62
345	600875	东方电气	795,958.00	2.59
346	601139	深圳燃气	792,005.00	2.58
347	603299	苏盐井神	786,996.00	2.56
348	600655	豫园股份	786,230.00	2.56
349	002583	海能达	780,824.00	2.54
350	603569	长久物流	770,964.00	2.51
351	300428	四通新材	761,170.60	2.48
352	000975	银泰资源	756,393.00	2.46
353	000732	泰禾集团	754,011.00	2.45
354	601108	财通证券	752,614.00	2.45
355	002714	牧原股份	744,234.00	2.42
356	600733	北汽蓝谷	740,477.00	2.41
357	002458	益生股份	737,424.00	2.40
358	603659	璞泰来	737,244.00	2.40
359	603600	永艺股份	734,899.00	2.39
360	600704	物产中大	730,611.00	2.38
361	600665	天地源	730,496.00	2.38
362	002380	科远股份	729,312.00	2.37
363	002146	荣盛发展	728,040.00	2.37
364	600141	兴发集团	725,973.00	2.36
365	300543	朗科智能	725,696.00	2.36
366	600598	北大荒	724,480.00	2.36
367	603658	安图生物	722,829.00	2.35
368	000887	中鼎股份	722,106.00	2.35
369	600184	光电股份	721,619.00	2.35

370	601137	博威合金	721,574.00	2.35
371	600478	科力远	719,735.00	2.34
372	603885	吉祥航空	715,800.24	2.33
373	603368	柳药股份	714,038.00	2.32
374	601865	福莱特	712,518.00	2.32
375	600780	通宝能源	712,243.00	2.32
376	000778	新兴铸管	708,285.00	2.31
377	603855	华荣股份	701,500.00	2.28
378	603586	金麒麟	700,942.00	2.28
379	300118	东方日升	697,316.00	2.27
380	002839	张家港行	696,996.00	2.27
381	300012	华测检测	684,231.00	2.23
382	603160	汇顶科技	680,221.00	2.21
383	000050	深天马 A	676,776.00	2.20
384	603200	上海洗霸	675,898.70	2.20
385	603816	顾家家居	675,297.00	2.20
386	600337	美克家居	675,112.00	2.20
387	002234	民和股份	674,177.00	2.19
388	002746	仙坛股份	673,604.00	2.19
389	002756	永兴特钢	671,937.00	2.19
390	603983	丸美股份	665,435.62	2.17
391	000970	中科三环	664,015.00	2.16
392	600879	航天电子	657,969.00	2.14
393	600885	宏发股份	656,868.00	2.14
394	002093	国脉科技	649,858.00	2.12
395	000573	粤宏远 A	645,758.00	2.10
396	600392	盛和资源	644,846.00	2.10
397	603008	喜临门	643,572.00	2.09

398	603813	原尚股份	637,570.00	2.08
399	300413	芒果超媒	635,073.00	2.07
400	601677	明泰铝业	631,841.00	2.06
401	603520	司太立	625,793.00	2.04
402	000656	金科股份	624,309.00	2.03
403	600761	安徽合力	623,658.00	2.03
404	600455	博通股份	618,976.00	2.01
405	300133	华策影视	616,877.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603444	吉比特	8,481,851.00	27.61
2	002048	宁波华翔	7,748,110.00	25.22
3	600580	卧龙电驱	7,638,673.28	24.86
4	002028	思源电气	7,428,593.00	24.18
5	600557	康缘药业	7,388,560.68	24.05
6	603355	莱克电气	7,298,315.90	23.76
7	601966	玲珑轮胎	7,287,978.00	23.72
8	601717	郑煤机	7,223,390.08	23.51
9	002444	巨星科技	7,088,520.00	23.07
10	600993	马应龙	7,060,222.92	22.98
11	002332	仙琚制药	6,952,216.30	22.63
12	600376	首开股份	6,787,969.20	22.10
13	603556	海兴电力	6,634,935.90	21.60
14	002439	启明星辰	6,634,551.00	21.60
15	002299	圣农发展	6,554,455.00	21.33

16	601811	新华文轩	6,469,425.74	21.06
17	002128	露天煤业	6,401,059.06	20.84
18	603806	福斯特	6,320,984.30	20.57
19	000877	天山股份	6,188,860.00	20.14
20	600750	江中药业	6,109,141.75	19.89
21	000528	柳工	6,067,037.22	19.75
22	601958	金钼股份	5,920,002.81	19.27
23	600801	华新水泥	5,859,115.07	19.07
24	600143	金发科技	5,854,514.20	19.06
25	600909	华安证券	5,844,788.00	19.02
26	600633	浙数文化	5,821,233.00	18.95
27	601928	凤凰传媒	5,816,138.00	18.93
28	000988	华工科技	5,703,792.00	18.57
29	600062	华润双鹤	5,583,991.20	18.18
30	002373	千方科技	5,568,513.00	18.13
31	600643	爱建集团	5,527,332.80	17.99
32	600267	海正药业	5,527,135.00	17.99
33	600985	淮北矿业	5,423,695.00	17.65
34	600565	迪马股份	5,374,037.66	17.49
35	000400	许继电气	5,355,041.83	17.43
36	000997	新大陆	5,300,765.53	17.25
37	000729	燕京啤酒	5,259,822.00	17.12
38	000027	深圳能源	5,223,982.50	17.00
39	002317	众生药业	5,215,155.00	16.98
40	600597	光明乳业	5,170,003.00	16.83
41	600466	蓝光发展	5,162,921.25	16.81
42	601311	骆驼股份	5,158,702.60	16.79
43	002250	联化科技	5,128,964.00	16.69

44	002152	广电运通	5,117,316.00	16.66
45	600348	阳泉煤业	5,085,124.00	16.55
46	300088	长信科技	5,076,692.80	16.52
47	600694	大商股份	5,047,835.34	16.43
48	600266	北京城建	5,006,537.60	16.30
49	000543	皖能电力	4,916,151.00	16.00
50	600582	天地科技	4,909,541.00	15.98
51	600765	中航重机	4,853,456.00	15.80
52	600863	内蒙华电	4,792,548.67	15.60
53	601001	大同煤业	4,763,728.72	15.51
54	002489	浙江永强	4,750,341.00	15.46
55	000061	农产品	4,738,180.90	15.42
56	002818	富森美	4,732,102.17	15.40
57	002463	沪电股份	4,677,010.62	15.22
58	601611	中国核建	4,639,512.14	15.10
59	002603	以岭药业	4,620,860.98	15.04
60	300115	长盈精密	4,613,171.00	15.02
61	600167	联美控股	4,599,591.40	14.97
62	600037	歌华有线	4,577,337.58	14.90
63	300058	蓝色光标	4,576,422.49	14.90
64	600970	中材国际	4,532,841.65	14.75
65	300418	昆仑万维	4,526,874.00	14.74
66	600329	中新药业	4,518,878.11	14.71
67	600779	水井坊	4,515,264.41	14.70
68	600064	南京高科	4,499,829.74	14.65
69	002916	深南电路	4,481,484.25	14.59
70	300166	东方国信	4,462,238.00	14.52
71	000301	东方盛虹	4,456,620.04	14.51

72	002745	木林森	4,442,934.00	14.46
73	600511	国药股份	4,434,736.00	14.44
74	603883	老百姓	4,396,376.00	14.31
75	000156	华数传媒	4,392,933.40	14.30
76	002004	华邦健康	4,339,486.00	14.13
77	600971	恒源煤电	4,275,375.27	13.92
78	600183	生益科技	4,265,603.25	13.88
79	000983	西山煤电	4,255,739.00	13.85
80	600718	东软集团	4,226,375.00	13.76
81	000009	中国宝安	4,174,029.00	13.59
82	600901	江苏租赁	4,159,835.00	13.54
83	600777	新潮能源	4,140,865.00	13.48
84	600073	上海梅林	4,094,462.00	13.33
85	600820	隧道股份	4,085,972.14	13.30
86	300315	掌趣科技	4,080,333.99	13.28
87	002375	亚厦股份	4,076,662.00	13.27
88	600410	华胜天成	4,024,125.00	13.10
89	600171	上海贝岭	3,979,603.00	12.95
90	601179	中国西电	3,961,955.00	12.90
91	002049	紫光国微	3,955,829.00	12.88
92	002607	中公教育	3,929,472.00	12.79
93	002414	高德红外	3,882,366.00	12.64
94	000848	承德露露	3,861,998.00	12.57
95	002690	美亚光电	3,846,986.00	12.52
96	600026	中远海能	3,846,772.00	12.52
97	600754	锦江股份	3,761,799.26	12.24
98	601118	海南橡胶	3,760,270.33	12.24
99	600642	申能股份	3,751,254.56	12.21

100	600757	长江传媒	3,749,273.80	12.20
101	000999	华润三九	3,730,829.51	12.14
102	600307	酒钢宏兴	3,722,627.00	12.12
103	002387	维信诺	3,720,620.00	12.11
104	601168	西部矿业	3,710,331.79	12.08
105	603198	迎驾贡酒	3,694,926.00	12.03
106	600939	重庆建工	3,691,647.00	12.02
107	600751	海航科技	3,686,294.00	12.00
108	600138	中青旅	3,684,656.00	11.99
109	000600	建投能源	3,672,087.00	11.95
110	300026	红日药业	3,667,951.00	11.94
111	000718	苏宁环球	3,640,950.43	11.85
112	000028	国药一致	3,626,729.00	11.81
113	600486	扬农化工	3,604,590.96	11.73
114	600755	厦门国贸	3,600,317.00	11.72
115	000685	中山公用	3,547,021.40	11.55
116	600312	平高电气	3,539,318.00	11.52
117	600699	均胜电子	3,533,293.60	11.50
118	000008	神州高铁	3,512,361.00	11.43
119	600058	五矿发展	3,497,192.99	11.38
120	600317	营口港	3,496,549.00	11.38
121	600120	浙江东方	3,462,892.40	11.27
122	600169	太原重工	3,442,632.65	11.21
123	002544	杰赛科技	3,425,703.00	11.15
124	601098	中南传媒	3,404,706.00	11.08
125	002251	步步高	3,378,364.00	11.00
126	600917	重庆燃气	3,371,164.00	10.97
127	600881	亚泰集团	3,369,204.50	10.97

128	600373	中文传媒	3,348,037.97	10.90
129	002831	裕同科技	3,335,690.20	10.86
130	601016	节能风电	3,314,535.00	10.79
131	600428	中远海特	3,292,981.00	10.72
132	600862	中航高科	3,287,339.00	10.70
133	002635	安洁科技	3,225,682.60	10.50
134	601000	唐山港	3,225,393.00	10.50
135	600717	天津港	3,217,830.40	10.47
136	000021	深科技	3,217,765.00	10.47
137	000636	风华高科	3,211,481.00	10.45
138	002191	劲嘉股份	3,199,436.00	10.41
139	601872	招商轮船	3,194,253.00	10.40
140	002244	滨江集团	3,158,649.00	10.28
141	002174	游族网络	3,156,117.00	10.27
142	300383	光环新网	3,120,589.00	10.16
143	000012	南玻 A	3,106,211.52	10.11
144	603766	隆鑫通用	3,072,965.00	10.00
145	600039	四川路桥	3,042,856.00	9.90
146	002242	九阳股份	3,020,567.88	9.83
147	600827	百联股份	3,008,165.00	9.79
148	002353	杰瑞股份	2,991,379.00	9.74
149	000031	大悦城	2,988,663.00	9.73
150	000623	吉林敖东	2,977,066.00	9.69
151	600060	海信电器	2,952,523.00	9.61
152	600787	中储股份	2,945,368.00	9.59
153	002416	爱施德	2,930,368.42	9.54
154	600017	日照港	2,893,676.00	9.42
155	600053	九鼎投资	2,892,576.49	9.42

156	600098	广州发展	2,867,236.00	9.33
157	603939	益丰药房	2,858,413.00	9.30
158	000537	广宇发展	2,853,115.81	9.29
159	603328	依顿电子	2,828,789.28	9.21
160	601699	潞安环能	2,817,195.80	9.17
161	002807	江阴银行	2,811,130.40	9.15
162	002399	海普瑞	2,791,938.67	9.09
163	000158	常山北明	2,788,972.80	9.08
164	000883	湖北能源	2,783,947.00	9.06
165	002195	二三四五	2,779,653.23	9.05
166	600315	上海家化	2,773,212.06	9.03
167	601333	广深铁路	2,754,935.00	8.97
168	002273	水晶光电	2,706,027.56	8.81
169	600823	世茂股份	2,705,055.96	8.81
170	600008	首创股份	2,698,379.00	8.78
171	600350	山东高速	2,688,831.00	8.75
172	600611	大众交通	2,687,237.00	8.75
173	600657	信达地产	2,685,402.00	8.74
174	600277	亿利洁能	2,678,459.40	8.72
175	002701	奥瑞金	2,677,491.00	8.72
176	000501	鄂武商 A	2,664,348.00	8.67
177	600729	重庆百货	2,659,091.00	8.66
178	601615	明阳智能	2,648,872.80	8.62
179	002268	卫士通	2,628,123.00	8.55
180	600673	东阳光科	2,611,573.00	8.50
181	600536	中国软件	2,580,369.00	8.40
182	601326	秦港股份	2,555,761.00	8.32
183	000598	兴蓉环境	2,551,578.97	8.31

184	601100	恒立液压	2,544,931.00	8.28
185	600575	皖江物流	2,515,023.00	8.19
186	600528	中铁工业	2,489,779.00	8.10
187	601231	环旭电子	2,487,188.00	8.10
188	002019	亿帆医药	2,486,425.00	8.09
189	600745	闻泰科技	2,450,218.00	7.98
190	603233	大参林	2,423,046.00	7.89
191	603000	人民网	2,418,119.00	7.87
192	002384	东山精密	2,382,555.40	7.76
193	000930	中粮生化	2,304,333.00	7.50
194	601801	皖新传媒	2,243,176.00	7.30
195	000513	丽珠集团	2,229,132.82	7.26
196	000987	越秀金控	2,220,699.01	7.23
197	600125	铁龙物流	2,194,310.00	7.14
198	002821	凯莱英	2,177,809.00	7.09
199	600739	辽宁成大	2,163,123.85	7.04
200	300459	金科文化	2,143,801.10	6.98
201	000690	宝新能源	2,142,943.00	6.98
202	002344	海宁皮城	2,138,890.92	6.96
203	600639	浦东金桥	2,132,081.99	6.94
204	600908	无锡银行	2,128,011.00	6.93
205	600978	宜华生活	2,115,761.77	6.89
206	002280	联络互动	2,102,363.00	6.84
207	600151	航天机电	2,089,023.00	6.80
208	300207	欣旺达	2,085,060.00	6.79
209	603501	韦尔股份	2,084,057.00	6.78
210	601005	重庆钢铁	2,069,362.00	6.74
211	002233	塔牌集团	2,067,701.00	6.73

212	002926	华西证券	2,063,541.00	6.72
213	000060	中金岭南	2,063,253.00	6.72
214	600021	上海电力	2,062,778.00	6.71
215	000926	福星股份	2,000,894.00	6.51
216	600563	法拉电子	1,990,922.00	6.48
217	002302	西部建设	1,986,969.00	6.47
218	600388	龙净环保	1,985,108.00	6.46
219	600869	智慧能源	1,974,145.00	6.43
220	600499	科达洁能	1,971,253.00	6.42
221	000066	中国长城	1,968,740.09	6.41
222	600584	长电科技	1,946,695.00	6.34
223	000878	云南铜业	1,939,249.00	6.31
224	002572	索菲亚	1,934,309.53	6.30
225	600648	外高桥	1,895,010.00	6.17
226	002707	众信旅游	1,884,686.82	6.13
227	603877	太平鸟	1,879,226.08	6.12
228	002382	蓝帆医疗	1,876,933.40	6.11
229	600903	贵州燃气	1,844,053.00	6.00
230	601969	海南矿业	1,806,139.81	5.88
231	000541	佛山照明	1,805,150.60	5.88
232	002249	大洋电机	1,800,726.00	5.86
233	300010	立思辰	1,799,467.00	5.86
234	300257	开山股份	1,770,160.00	5.76
235	000552	靖远煤电	1,759,047.00	5.73
236	603712	七一二	1,703,102.00	5.54
237	002512	达华智能	1,672,251.00	5.44
238	300002	神州泰岳	1,667,975.00	5.43
239	300055	万邦达	1,649,267.00	5.37

240	600079	人福医药	1,641,942.75	5.34
241	603568	伟明环保	1,616,812.00	5.26
242	601866	中远海发	1,608,985.00	5.24
243	000401	冀东水泥	1,587,033.00	5.17
244	600415	小商品城	1,564,108.00	5.09
245	000829	天音控股	1,540,314.00	5.01
246	603377	东方时尚	1,528,393.00	4.97
247	002405	四维图新	1,512,926.00	4.92
248	601608	中信重工	1,504,540.00	4.90
249	600418	江淮汽车	1,500,038.00	4.88
250	600056	中国医药	1,495,330.61	4.87
251	000049	德赛电池	1,481,807.00	4.82
252	002812	恩捷股份	1,472,027.00	4.79
253	601019	山东出版	1,454,641.00	4.73
254	600380	健康元	1,451,462.60	4.72
255	600335	国机汽车	1,419,283.00	4.62
256	002440	闰土股份	1,413,633.00	4.60
257	002465	海格通信	1,410,361.72	4.59
258	000006	深振业 A	1,399,340.00	4.55
259	000738	航发控制	1,398,683.00	4.55
260	603056	德邦股份	1,378,784.00	4.49
261	002074	国轩高科	1,371,939.00	4.47
262	002340	格林美	1,367,550.00	4.45
263	002223	鱼跃医疗	1,355,014.00	4.41
264	002500	山西证券	1,323,521.00	4.31
265	002372	伟星新材	1,318,604.16	4.29
266	300134	大富科技	1,305,995.00	4.25
267	000937	冀中能源	1,300,159.24	4.23

268	300316	晶盛机电	1,292,532.00	4.21
269	600707	彩虹股份	1,292,146.00	4.21
270	000090	天健集团	1,285,117.93	4.18
271	600521	华海药业	1,233,479.00	4.02
272	002221	东华能源	1,230,095.00	4.00
273	002266	浙富控股	1,223,570.00	3.98
274	600435	北方导航	1,196,518.00	3.89
275	600859	王府井	1,188,491.00	3.87
276	600874	创业环保	1,167,675.00	3.80
277	600763	通策医疗	1,167,425.00	3.80
278	300244	迪安诊断	1,164,463.00	3.79
279	601799	星宇股份	1,161,943.00	3.78
280	000869	张裕 A	1,154,572.32	3.76
281	600500	中化国际	1,152,265.00	3.75
282	300009	安科生物	1,125,916.00	3.66
283	601689	拓普集团	1,124,314.00	3.66
284	600664	哈药股份	1,119,521.00	3.64
285	002936	郑州银行	1,117,174.00	3.64
286	603515	欧普照明	1,114,376.00	3.63
287	002946	新乳业	1,112,449.00	3.62
288	002056	横店东磁	1,106,355.24	3.60
289	002318	久立特材	1,099,963.00	3.58
290	000596	古井贡酒	1,095,189.00	3.56
291	000778	新兴铸管	1,090,827.95	3.55
292	002437	誉衡药业	1,088,857.00	3.54
293	000960	锡业股份	1,088,382.00	3.54
294	600316	洪都航空	1,079,185.00	3.51
295	000059	华锦股份	1,067,881.00	3.48

296	603866	桃李面包	1,063,679.80	3.46
297	603858	步长制药	1,059,599.00	3.45
298	600748	上实发展	1,058,010.00	3.44
299	600737	中粮糖业	1,026,068.89	3.34
300	002345	潮宏基	1,017,539.40	3.31
301	601106	中国一重	1,007,231.00	3.28
302	002672	东江环保	993,547.00	3.23
303	603650	彤程新材	986,069.00	3.21
304	002641	永高股份	972,117.00	3.16
305	601200	上海环境	966,563.69	3.15
306	002127	南极电商	966,074.00	3.14
307	002948	青岛银行	954,283.17	3.11
308	002371	北方华创	951,030.00	3.10
309	600570	恒生电子	949,924.20	3.09
310	000750	国海证券	945,530.00	3.08
311	600655	豫园股份	945,286.00	3.08
312	002129	中环股份	939,824.00	3.06
313	600848	上海临港	939,628.88	3.06
314	000887	中鼎股份	933,436.00	3.04
315	601678	滨化股份	933,020.90	3.04
316	600478	科力远	931,233.00	3.03
317	600782	新钢股份	929,513.00	3.03
318	600258	首旅酒店	920,795.00	3.00
319	600770	综艺股份	916,938.00	2.98
320	600727	鲁北化工	916,398.00	2.98
321	002563	森马服饰	915,195.00	2.98
322	600195	中牧股份	903,134.60	2.94
323	600623	华谊集团	899,361.00	2.93

324	600393	粤泰股份	895,553.00	2.92
325	002276	万马股份	894,774.00	2.91
326	002092	中泰化学	892,308.74	2.90
327	002482	广田集团	885,754.12	2.88
328	300569	天能重工	883,501.00	2.88
329	600325	华发股份	870,726.00	2.83
330	300017	网宿科技	863,036.00	2.81
331	002368	太极股份	844,706.00	2.75
332	002583	海能达	843,784.00	2.75
333	603369	今世缘	843,413.00	2.75
334	002020	京新药业	836,106.00	2.72
335	600743	华远地产	823,792.00	2.68
336	002254	泰和新材	823,015.00	2.68
337	600216	浙江医药	822,906.00	2.68
338	601139	深圳燃气	821,171.01	2.67
339	000519	中兵红箭	819,073.00	2.67
340	600496	精工钢构	816,203.00	2.66
341	603885	吉祥航空	812,825.80	2.65
342	600845	宝信软件	810,580.00	2.64
343	603299	苏盐井神	807,758.00	2.63
344	000025	特力A	807,073.00	2.63
345	600141	兴发集团	802,949.00	2.61
346	600618	氯碱化工	796,475.10	2.59
347	600875	东方电气	796,048.00	2.59
348	601137	博威合金	784,823.00	2.55
349	600184	光电股份	766,458.00	2.49
350	000975	银泰资源	759,741.20	2.47
351	603600	永艺股份	754,851.00	2.46

352	002277	友阿股份	754,348.00	2.46
353	603586	金麒麟	748,496.00	2.44
354	002458	益生股份	747,338.00	2.43
355	000023	深天地 A	746,724.00	2.43
356	601865	福莱特	745,972.00	2.43
357	300014	亿纬锂能	745,086.00	2.43
358	000078	海王生物	743,326.00	2.42
359	600665	天地源	740,431.00	2.41
360	603658	安图生物	738,466.00	2.40
361	603855	华荣股份	736,040.00	2.40
362	002146	荣盛发展	734,777.00	2.39
363	600160	巨化股份	733,122.09	2.39
364	300428	四通新材	732,559.00	2.38
365	002380	科远股份	731,372.00	2.38
366	600780	通宝能源	730,078.00	2.38
367	603659	璞泰来	726,895.00	2.37
368	600733	北汽蓝谷	724,317.00	2.36
369	600879	航天电子	723,399.00	2.35
370	300118	东方日升	721,594.00	2.35
371	000656	金科股份	721,244.00	2.35
372	000039	中集集团	716,784.98	2.33
373	000970	中科三环	714,224.00	2.32
374	002234	民和股份	703,755.00	2.29
375	300251	光线传媒	703,476.00	2.29
376	600598	北大荒	701,620.00	2.28
377	002756	永兴特钢	696,468.00	2.27
378	600426	华鲁恒升	693,485.00	2.26
379	002925	盈趣科技	690,688.00	2.25

380	600337	美克家居	688,700.00	2.24
381	603200	上海洗霸	683,582.45	2.23
382	600728	佳都科技	680,770.00	2.22
383	603569	长久物流	678,498.00	2.21
384	600885	宏发股份	672,603.00	2.19
385	603228	景旺电子	670,498.40	2.18
386	600704	物产中大	670,434.00	2.18
387	000732	泰禾集团	670,402.00	2.18
388	601108	财通证券	668,592.00	2.18
389	002839	张家港行	667,069.00	2.17
390	600567	山鹰纸业	665,496.00	2.17
391	603008	喜临门	664,681.00	2.16
392	300543	朗科智能	662,679.00	2.16
393	603816	顾家家居	658,195.00	2.14
394	002714	牧原股份	648,870.00	2.11
395	603661	恒林股份	647,320.00	2.11
396	300012	华测检测	645,680.00	2.10
397	603813	原尚股份	642,852.00	2.09
398	002082	万邦德	640,118.00	2.08
399	603520	司太立	638,081.60	2.08
400	002640	跨境通	636,865.00	2.07
401	000062	深圳华强	635,339.00	2.07
402	002308	威创股份	635,282.00	2.07
403	600392	盛和资源	634,830.00	2.07
404	002093	国脉科技	634,475.00	2.07
405	600808	马钢股份	632,565.56	2.06
406	603368	柳药股份	629,730.00	2.05
407	002589	瑞康医药	629,170.59	2.05

408	000686	东北证券	625,976.00	2.04
409	300413	芒果超媒	625,539.00	2.04
410	600455	博通股份	618,755.00	2.01

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	1,274,129,043.77
卖出股票收入（成交）总额	1,224,527,520.78

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,302,760.00	2.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,158,625.00	1.06
	其中：政策性金融债	1,158,625.00	1.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	892,026.50	0.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,353,411.50	4.00

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	019615	19 国债 05	23,000	2,302,760.00	2.12
2	018007	国开 1801	11,500	1,158,625.00	1.06
3	128034	江银转债	7,480	842,547.20	0.77
4	113543	欧派转债	390	49,479.30	0.05

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	115,150.75
2	应收证券清算款	200,933.53
3	应收股利	-
4	应收利息	58,621.26
5	应收申购款	270,876.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	645,582.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688218	江苏北人	135,949.20	0.12	流通受限
2	688399	硕世生物	124,827.90	0.11	流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 金 中 证 500A	2,175	32,722.12	37,705,957.40	52.98%	33,464,654.40	47.02%
中 金 中 证 500C	3,990	7,216.99	4,936,321.45	17.14%	23,859,455.30	82.86%
合计	6,165	16,215.15	42,642,278.85	42.66%	57,324,109.70	57.34%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金中证 500A	386,182.40	0.5426%
	中金中证 500C	43,566.47	0.1513%
	合计	429,748.87	0.4299%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中金中证 500A	0~10
	中金中证 500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	中金中证 500A	0
	中金中证 500C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 500A	中金中证 500C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金 份额总额	10,001,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	30,788,524.27	6,926,726.59
本报告期基金总申购份额	218,414,307.03	74,653,882.23
减:本报告期基金总赎回份额	178,032,219.50	52,784,832.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	71,170,611.80	28,795,776.75

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金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

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2019 年 1 月 19 日，本基金管理人发布公告，楚钢先生自 2019 年 1 月 18 日起担任公司董事长，同日起总经理孙菁不再代为履行董事长职务。

2019 年 5 月 6 日，本基金管理人发布公告，王元先生自 2019 年 5 月 5 日起接替颜羽女士担任公司独立董事。

2019 年 6 月 18 日，本基金管理人发布公告，夏静女士自 2019 年 6 月 17 日起担任公司首席信息官，分管信息技术及风险管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，基金管理人与股东中金公司就南京中金基金管理有限公司（以下简称“南京中金基金”）侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院（以下简称“南京中院”）起诉，南京中院于 2018 年 10 月 22 日立案。2019 年 5 月 20 日，南京中院出具（2018）苏 01 民初 2710 号民事调解书，确认基金管理人及股东中金公司与南京中金基金 2019 年 5 月 17 日签署的调解协议内容。截至本报告期末，南京中金基金已根据调解协议完成更名并支付赔偿款项。除前述事项外，本报告期无涉及基金管理人的其他诉讼事项。

本报告期无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
中金公司	2	1,028,115,418.19	41.22%	751,862.56	41.22%	-
兴业证券	2	771,739,162.80	30.94%	564,373.12	30.94%	-
华创证券	2	346,017,321.72	13.87%	253,043.11	13.87%	-
中金财富证券	2	280,210,548.24	11.24%	204,918.17	11.24%	-
长江证券	4	67,942,766.49	2.72%	49,687.73	2.72%	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中金公司	8,007,417.58	36.68%	136,600,000.00	33.40%	-	-
兴业证券	6,808,887.31	31.19%	140,600,000.00	34.38%	-	-
华创证券	2,301,520.90	10.54%	26,300,000.00	6.43%	-	-
中金财富证 券	4,058,772.61	18.59%	84,700,000.00	20.71%	-	-
长江证券	651,380.00	2.98%	20,800,000.00	5.09%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金基金管理有限公司董事长任 职公告	中国证监会指定媒介	2019年1月19日
2	中金中证500指数增强型发起式 证券投资基金2018年第4季度报	中国证监会指定媒介	2019年1月22日
3	中金中证500指数增强型发起式 证券投资基金更新招募说明书及 其摘要(2019年第1号)	中国证监会指定媒介	2019年3月8日
4	中金基金管理有限公司关于旗下 基金开展网上直销费率优惠活 动的公告	中国证监会指定媒介	2019年3月12日
5	中金中证500指数增强型发起式 证券投资基金2018年年度报告及 其摘要	中国证监会指定媒介	2019年3月28日
6	中金中证500指数增强型发起式 证券投资基金2019年第1季度报 告	中国证监会指定媒介	2019年4月19日

7	中金基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定投申购数额限制的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 4 月 24 日
8	关于旗下部分基金增加腾安基金为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 4 月 27 日
9	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 5 月 6 日
10	关于新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 5 月 8 日
11	中金基金管理有限公司首席信息官任职公告	中国证监会指定媒介	2019 年 6 月 18 日
12	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 6 月 25 日
13	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2019 年 7 月 19 日
14	关于中金沪深 300 指数增强、中金中证 500 指数增强新增招商银行为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 8 月 21 日
15	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告	中国证监会指定媒介	2019 年 8 月 26 日
16	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2019 年第 2 号）	中国证监会指定媒介	2019 年 8 月 31 日
17	关于新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 9 月 17 日
18	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 9 月 21 日

	告		
19	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 24 日
20	中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 24 日
21	关于旗下部分基金新增中信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 12 日
22	关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2019 年 11 月 21 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2019 年 12 月 27 日至 2019 年 12 月 31 日	0.00	107,505,070.99	87,252,535.00	20,252,535.99	20.26%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人于 2019 年 6 月组织了监事换届选举工作。根据选举结果，由公司基金运营部负责人白娜女士自 2019 年 6 月 17 日起接替夏静女士担任执行监事。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2020 年 4 月 21 日