

---

**中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金**

**2020 年中期报告**

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月1日起至2020年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63

§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中融500
场内简称	中融500（基金扩位简称：中融中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,345,700.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-12-25

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为

	指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中融基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健
	联系电话	010-56517129
	电子邮箱	caojian@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	95595
传真	010-56517001	010-63639132
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦17楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100102	100033
法定代表人	王瑶	李晓鹏

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	15,514,215.33
本期利润	17,266,797.33
加权平均基金份额本期利润	0.1295
本期加权平均净值利润率	11.93%
本期基金份额净值增长率	12.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	13,525,732.56
期末可供分配基金份额利润	0.1795
期末基金资产净值	88,950,264.05
期末基金份额净值	1.1806
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	18.06%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.58%	0.84%	8.47%	0.88%	0.11%	-0.04%
过去三个月	16.46%	1.04%	16.32%	1.13%	0.14%	-0.09%
过去六个月	12.50%	1.62%	11.33%	1.79%	1.17%	-0.17%
自基金合同	18.06%	1.45%	19.39%	1.63%	-1.33%	-0.18%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金11.5亿元人民币。截至2020年6月30日，中融基金管理有限公司共管理55只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置

混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融国证钢铁	2019-11-15	-	11	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业

	行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及指数投资部总经理。				资格，证券从业年限11年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任指数投资部总经理职位。
陈薪羽	中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金的基金经理。	2019-11-28	-	4	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限4年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入中融基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理。

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；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

##### 4.3.2 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。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年上半年，中证500指数上涨11.87%，本基金作为一只投资于中证500指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融500基金份额净值为1.1806元，本报告期内，基金份额净值增长率为12.50%，同期业绩比较基准收益率为11.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，新冠疫情带来了明显的通缩压力，受疫情防控措施的影响，国内经济供需两弱，生产者价格指数（PPI）、消费者价格指数（CPI）（剔除猪价影响）同比增长率显著下降，然而6月份以来，制造业采购经理指数（PMI）中的“生产量”和“购进价格”两个先行指标已经明显回升至扩张收缩临界点，预示着PPI的触底回升和通胀压力的抬头。

展望下半年，中国经济已呈现出快速修复之势，投资率先发力，消费接续回升，疫情决定国内经济复苏的速度和节奏，疫苗的研发进度决定经济复苏的二次加速时点。货币政策方面，从今年一季度“危机应对式的极度宽松”转向了第二季度的“常态式宽松”，下半年随着通胀和房价压力的抬头，或将转向“有节制的宽松”，央行会把更多的注意力放在社融高增长可能带来的副作用上。财政政策方面，当前财政支出进度相对缓慢，下半年财政支出力度有望明显提升。在项目储备数量增加，国内贷款和政府性基金明显扩张的双重利好下，基建增速将继续回升。权益方面，A股估值和风险偏好已有所修复，确定性溢价仍然存在，所以业绩高增长和短期确定性仍然是市场的主要偏好，增量资金的持续流入，使得市场流动性和风险偏好进一步提升，低估值板块补涨。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争使投资者充分获得指数的长期收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，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；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中融中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金2020年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资 产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,129,798.31	15,402,955.18
结算备付金		1,420,083.31	1,782,507.02
存出保证金		1,112,539.16	33,327.77
交易性金融资产	6.4.7.2	80,740,925.14	100,877,089.16
其中：股票投资		80,740,925.14	100,877,089.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		17,073.20	11,095,168.80
应收利息	6.4.7.5	1,537.01	6,092.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		89,421,956.13	129,197,140.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		283,428.02	14,739,449.38
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		24,650.06	56,884.08
应付托管费		8,216.69	18,961.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	89,936.65	243,295.28
应交税费		15,542.12	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	49,918.54	3,589,598.46
负债合计		471,692.08	18,648,188.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	75,345,700.00	105,345,700.00
未分配利润	6.4.7.10	13,604,564.05	5,203,252.18
所有者权益合计		88,950,264.05	110,548,952.18
负债和所有者权益总计		89,421,956.13	129,197,140.74

注：报告截止日2020年6月30日，基金份额总额75,345,700.00份，份额净值1.1806元。

## 6.2 利润表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		18,187,170.91
1. 利息收入		56,601.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,601.28
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,838,913.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,117,127.76
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	721,785.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,752,582.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	539,074.12
<b>减：二、费用</b>		920,373.58
1. 管理人报酬		210,368.97
2. 托管费		70,122.97
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	554,963.10
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	84,918.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,266,797.33
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,266,797.33

注：本基金基金合同于2019年11月15日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	105,345,700.00	5,203,252.18	110,548,952.18
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	17,266,797.33	17,266,797.33
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)	-30,000,000.00	-8,865,485.46	-38,865,485.46
其中：1. 基金申购款	224,000,000.00	16,558,504.64	240,558,504.64
2. 基金赎回 款	-254,000,000.00	-25,423,990.10	-279,423,990.10
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)	75,345,700.00	13,604,564.05	88,950,264.05

注：本基金基金合同于2019年11月15日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

黎峰

李同庆

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019] 157号文《关于准予中融中证500

交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》批准，由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于2019年11月15日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金募集期为2019年9月3日至2019年11月8日，本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金235,339,130.00元，折合235,339,130.00份中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币6,570.00元，折合6,570.00份中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额，以上收到的实收基金共计人民币235,345,700.00元，折合235,345,700.00份中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额，有效认购户数为3,638户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金主要投资于标的指数，即中证500指数成份股和备选。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券等）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日起至12月31日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资（主要为权证投资）等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### (2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提；

本基金的托管费按《基金合同》约定的方法进行计提；

本基金销售服务费率以《基金合同》的约定为准；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管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。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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《中国证监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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之

附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《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[2012]85号《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《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民

共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

6、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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
----	--------------------

活期存款	6,129,798.31
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	6,129,798.31

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	74,644,638.85	80,740,925.14	6,096,286.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	74,644,638.85	80,740,925.14	6,096,286.29

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,984,160.00	-	-	-

股指期货	7,984,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,984,160.00	-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	1,376.71
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	90.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	69.50
合计	1,537.01

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	89,936.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	89,936.65

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	14,918.54
应付指数使用费	35,000.00
合计	49,918.54

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	105,345,700.00	105,345,700.00
本期申购	224,000,000.00	224,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-254,000,000.00	-254,000,000.00
本期末	75,345,700.00	75,345,700.00

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,552,335.27	1,650,916.91	5,203,252.18
本期利润	15,514,215.33	1,752,582.00	17,266,797.33
本期基金份额交易产	-5,540,818.04	-3,324,667.42	-8,865,485.46

生的变动数			
其中：基金申购款	23,591,095.86	-7,032,591.22	16,558,504.64
基金赎回款	-29,131,913.90	3,707,923.80	-25,423,990.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,525,732.56	78,831.49	13,604,564.05

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	46,233.75
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	9,197.88
其他	1,169.65
合计	56,601.28

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,813,552.19
股票投资收益——赎回差价收入	4,303,575.57
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	15,117,127.76

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	214,521,459.46
减：卖出股票成本总额	203,707,907.27

买卖股票差价收入	10,813,552.19
----------	---------------

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
赎回基金份额对价总额	279,423,990.10
减：现金支付赎回款总额	151,925,274.10
减：赎回股票成本总额	123,195,140.43
赎回差价收入	4,303,575.57

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	721,785.75
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	721,785.75
----	------------

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	1,291,684.12
——股票投资	1,291,684.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	476,440.00
——权证投资	-
——期货投资	476,440.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	15,542.12
合计	1,752,582.00

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	539,073.92
其他	0.20
合计	539,074.12

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	554,779.40
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	183.70
合计	554,963.10

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
审计费用	14,918.54
指数使用费	70,000.00
合计	84,918.54

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	210,368.97
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：

①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年

天数；

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

④本基金基金合同于2019年11月15日生效，无上年可比期间。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,122.97

注：

①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

③本基金基金合同于2019年11月15日生效，无上年可比期间。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中融中证500ETF联接基金	66,246,100.00	87.92%	-	-

注：本基金基金合同自2019年11月15日起生效，无上年可比期间。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	6,129,798.31	46,233.75

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人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，按银行同业利率计息。

本基金基金合同自2019年11月15日起生效，无上年可比期间。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	--------	--------	----

				单 价		单 价				
6018 80	大连 港	2020 -06- 22	公告重大 事项	1.72	2020-07 -08	1.89	53,300	96,790.95	91,676.00	-
0024 70	*ST 金正	2020 -06- 30	股票交易 异常波动	2.27	2020-07 -01	2.16	27,200	69,919.86	61,744.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,129,798.31	-	-	-	6,129,798.31
结算备付金	1,420,083.31	-	-	-	1,420,083.31
存出保证金	1,112,539.16	-	-	-	1,112,539.16
交易性金融资产	-	-	-	80,740,925.14	80,740,925.14

应收证券清算款	-	-	-	17,073.20	17,073.20
应收利息	-	-	-	1,537.01	1,537.01
资产总计	8,662,420.78	-	-	80,759,535.35	89,421,956.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	283,428.02	283,428.02
应付管理人报酬	-	-	-	24,650.06	24,650.06
应付托管费	-	-	-	8,216.69	8,216.69
应付交易费用	-	-	-	89,936.65	89,936.65
应交税费	-	-	-	15,542.12	15,542.12
其他负债	-	-	-	49,918.54	49,918.54
负债总计	-	-	-	471,692.08	471,692.08
利率敏感度缺口	8,662,420.78	-	-	80,287,843.27	88,950,264.05
上年度末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	15,402,955.18	-	-	-	15,402,955.18
结算备付金	1,782,507.02	-	-	-	1,782,507.02
存出保证金	33,327.77	-	-	-	33,327.77
交易性金融资产	-	-	-	100,877,089.16	100,877,089.16
应收证券清算款	-	-	-	11,095,168.80	11,095,168.80
应收利息	-	-	-	6,092.81	6,092.81
资产总计	17,218,789.97	-	-	111,978,350.77	129,197,140.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,223,504.36	18,223,504.36
应付管理人报酬	-	-	-	56,884.08	56,884.08
应付托管费	-	-	-	18,961.36	18,961.36
应付交易费用	-	-	-	243,295.28	243,295.28
其他负债	-	-	-	105,543.48	105,543.48
负债总计	-	-	-	18,648,188.56	18,648,188.56
利率敏感度缺口	17,218,789.97	-	-	93,330,162.21	110,548,952.18

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于报告期末，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值可参考的公允价值发生的变动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	80,740,925.14	90.77	100,877,089.16	91.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	80,740,925.14	90.77	100,877,089.16	91.25

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	沪深300指数上升5%	4,171,717.11	2,644,444.49
	沪深300指数下降5%	-4,171,717.11	-2,644,444.49

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### ② 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币80,740,925.14元，无属于第二层次和第三层次的余额。

### ③ 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	80,740,925.14	90.29
	其中：股票	80,740,925.14	90.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	7,549,881.62	8.44
8	其他各项资产	1,131,149.37	1.26
9	合计	89,421,956.13	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	727,107.00	0.82
B	采矿业	1,892,674.00	2.13
C	制造业	47,044,596.25	52.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,848,336.40	2.08
E	建筑业	1,048,214.00	1.18
F	批发和零售业	4,490,281.00	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,699,084.28	1.91
H	住宿和餐饮业	271,572.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,079,622.01	10.21
J	金融业	4,146,063.80	4.66
K	房地产业	2,852,907.40	3.21
L	租赁和商务服务业	1,654,667.00	1.86
M	科学研究和技术服务业	587,270.00	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	774,723.00	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,488.00	0.09
Q	卫生和社会工作	581,780.00	0.65
R	文化、体育和娱乐业	1,263,434.00	1.42
S	综合	699,105.00	0.79
	合计	80,740,925.14	90.77

## 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有积极投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁健康	28,210	647,137.40	0.73
2	002127	南极电商	28,400	601,228.00	0.68
3	002821	凯莱英	2,200	534,600.00	0.60
4	600201	生物股份	18,600	517,824.00	0.58
5	002185	华天科技	36,200	489,786.00	0.55
6	600739	辽宁成大	25,300	478,929.00	0.54
7	300558	贝达药业	3,300	461,934.00	0.52
8	600529	山东药玻	7,800	452,400.00	0.51
9	002439	启明星辰	10,729	451,369.03	0.51
10	300088	长信科技	40,300	451,360.00	0.51
11	002385	大北农	48,500	441,835.00	0.50
12	300012	华测检测	22,000	434,720.00	0.49
13	002131	利欧股份	111,700	431,162.00	0.48
14	300285	国瓷材料	12,700	425,577.00	0.48
15	600079	人福医药	15,600	424,632.00	0.48
16	600521	华海药业	11,937	405,022.41	0.46
17	600298	安琪酵母	8,100	400,788.00	0.45
18	002465	海格通信	30,500	394,670.00	0.44
19	600143	金发科技	29,800	392,466.00	0.44
20	600161	天坛生物	8,600	389,838.00	0.44
21	603444	吉比特	700	384,307.00	0.43
22	002075	沙钢股份	29,200	365,000.00	0.41
23	000009	中国宝安	42,600	362,526.00	0.41
24	002223	鱼跃医疗	9,900	360,360.00	0.41

25	300496	中科创达	4,600	357,420.00	0.40
26	601099	太平洋	112,700	357,259.00	0.40
27	002212	南洋股份	13,400	356,172.00	0.40
28	603517	绝味食品	5,000	353,700.00	0.40
29	300482	万孚生物	3,400	353,600.00	0.40
30	002074	国轩高科	13,000	348,920.00	0.39
31	300595	欧普康视	5,000	346,700.00	0.39
32	002273	水晶光电	20,100	344,514.00	0.39
33	000636	风华高科	11,800	344,442.00	0.39
34	300207	欣旺达	18,100	342,090.00	0.38
35	601128	常熟银行	45,300	340,203.00	0.38
36	300418	昆仑万维	13,500	336,960.00	0.38
37	300315	掌趣科技	45,600	334,248.00	0.38
38	600426	华鲁恒升	18,800	332,384.00	0.37
39	603882	金域医学	3,700	331,150.00	0.37
40	002507	涪陵榨菜	9,100	327,691.00	0.37
41	000988	华工科技	13,300	324,919.00	0.37
42	300357	我武生物	5,100	317,475.00	0.36
43	002340	格林美	63,300	314,601.00	0.35
44	603939	益丰药房	3,420	311,220.00	0.35
45	002603	以岭药业	9,900	308,781.00	0.35
46	000975	银泰黄金	19,600	307,328.00	0.35
47	002414	高德红外	10,460	306,268.80	0.34
48	300271	华宇软件	10,741	303,003.61	0.34
49	300168	万达信息	13,700	302,359.00	0.34
50	300212	易华录	5,300	296,800.00	0.33
51	002373	千方科技	12,300	295,077.00	0.33
52	002353	杰瑞股份	9,500	294,500.00	0.33
53	600885	宏发股份	7,300	292,876.00	0.33
54	000513	丽珠集团	6,100	292,861.00	0.33
55	600132	重庆啤酒	4,000	292,000.00	0.33

56	600859	王府井	6,400	291,520.00	0.33
57	600699	均胜电子	12,200	290,482.00	0.33
58	000547	航天发展	21,200	289,804.00	0.33
59	002156	通富微电	11,400	285,570.00	0.32
60	300024	机器人	20,600	281,602.00	0.32
61	300009	安科生物	15,720	281,388.00	0.32
62	002797	第一创业	40,500	280,260.00	0.32
63	002019	亿帆医药	12,200	280,234.00	0.32
64	601799	星宇股份	2,200	279,400.00	0.31
65	002030	达安基因	10,099	275,500.72	0.31
66	000750	国海证券	63,000	273,420.00	0.31
67	300017	网宿科技	32,200	273,378.00	0.31
68	603858	步长制药	9,400	271,190.00	0.30
69	002557	洽洽食品	5,000	270,950.00	0.30
70	002195	二三四五	94,700	266,107.00	0.30
71	002174	游族网络	10,200	266,016.00	0.30
72	002250	联化科技	12,200	265,960.00	0.30
73	600801	华新水泥	11,200	265,552.00	0.30
74	002138	顺络电子	10,600	264,470.00	0.30
75	000021	深科技	12,100	264,143.00	0.30
76	600315	上海家化	5,500	263,450.00	0.30
77	300316	晶盛机电	10,600	262,244.00	0.29
78	600380	健康元	16,100	261,464.00	0.29
79	600895	张江高科	12,800	260,736.00	0.29
80	603233	大参林	3,200	259,904.00	0.29
81	000050	深天马 A	16,900	259,584.00	0.29
82	002152	广电运通	19,900	257,506.00	0.29
83	300058	蓝色光标	32,900	256,620.00	0.29
84	300070	碧水源	31,400	254,968.00	0.29
85	002572	索菲亚	10,500	253,785.00	0.29
86	000998	隆平高科	15,200	253,080.00	0.28

87	300244	迪安诊断	7,100	250,630.00	0.28
88	000401	冀东水泥	15,600	250,224.00	0.28
89	600845	宝信软件	4,200	248,136.00	0.28
90	600486	扬农化工	3,000	247,500.00	0.28
91	600667	太极实业	20,900	247,038.00	0.28
92	600410	华胜天成	18,100	246,160.00	0.28
93	600037	歌华有线	16,100	244,720.00	0.28
94	002078	太阳纸业	25,700	244,664.00	0.28
95	600535	天士力	15,000	243,300.00	0.27
96	300274	阳光电源	16,800	241,752.00	0.27
97	600155	华创阳安	20,100	240,999.00	0.27
98	002511	中顺洁柔	10,800	240,840.00	0.27
99	000623	吉林敖东	15,300	240,669.00	0.27
100	600642	申能股份	40,600	239,946.00	0.27
101	603338	浙江鼎力	3,160	239,433.20	0.27
102	002500	山西证券	36,500	238,710.00	0.27
103	002382	蓝帆医疗	7,900	237,869.00	0.27
104	002396	星网锐捷	6,700	236,711.00	0.27
105	002013	中航机电	29,800	235,420.00	0.26
106	000630	铜陵有色	121,900	235,267.00	0.26
107	601233	桐昆股份	18,300	233,508.00	0.26
108	600126	杭钢股份	22,300	231,920.00	0.26
109	002690	美亚光电	4,400	231,440.00	0.26
110	600879	航天电子	35,900	231,196.00	0.26
111	002926	华西证券	21,700	230,671.00	0.26
112	600153	建发股份	28,100	227,610.00	0.26
113	603707	健友股份	3,500	225,995.00	0.25
114	000739	普洛药业	9,700	225,913.00	0.25
115	300010	立思辰	11,400	223,098.00	0.25
116	600884	杉杉股份	18,845	222,182.55	0.25
117	002281	光迅科技	6,700	220,162.00	0.25

118	600415	小商品城	45,000	219,150.00	0.25
119	600811	东方集团	49,100	217,022.00	0.24
120	600167	联美控股	15,100	216,534.00	0.24
121	603659	璞泰来	2,100	216,342.00	0.24
122	001914	招商积余	7,000	215,110.00	0.24
123	600216	浙江医药	11,100	213,786.00	0.24
124	600804	鹏博士	23,700	212,826.00	0.24
125	300251	光线传媒	19,400	211,654.00	0.24
126	600728	佳都科技	23,100	210,441.00	0.24
127	300001	特锐德	9,900	207,306.00	0.23
128	002268	卫士通	9,700	206,998.00	0.23
129	300115	长盈精密	9,000	205,650.00	0.23
130	002294	信立泰	6,900	204,654.00	0.23
131	002028	思源电气	9,999	204,579.54	0.23
132	600909	华安证券	29,900	204,217.00	0.23
133	300002	神州泰岳	32,400	200,556.00	0.23
134	600779	水井坊	3,200	199,744.00	0.22
135	600511	国药股份	4,900	199,283.00	0.22
136	000581	威孚高科	9,600	198,528.00	0.22
137	600325	华发股份	28,000	197,680.00	0.22
138	000686	东北证券	23,200	196,040.00	0.22
139	600528	中铁工业	22,000	194,040.00	0.22
140	600418	江淮汽车	21,900	193,377.00	0.22
141	000997	新大陆	12,100	193,358.00	0.22
142	002387	维信诺	13,500	192,780.00	0.22
143	601689	拓普集团	6,900	192,510.00	0.22
144	600446	金证股份	9,900	192,060.00	0.22
145	600460	士兰微	13,000	190,840.00	0.21
146	600827	百联股份	13,200	190,740.00	0.21
147	603883	老百姓	1,900	190,076.00	0.21
148	600598	北大荒	11,700	188,370.00	0.21

149	000999	华润三九	6,400	186,816.00	0.21
150	600959	江苏有线	49,600	186,496.00	0.21
151	002242	九阳股份	5,000	186,350.00	0.21
152	600733	北汽蓝谷	28,900	185,827.00	0.21
153	002317	众生药业	10,700	183,612.00	0.21
154	601168	西部矿业	31,500	182,700.00	0.21
155	600256	广汇能源	67,400	181,980.00	0.20
156	603000	人民网	9,100	180,453.00	0.20
157	603806	福斯特	3,600	179,676.00	0.20
158	600260	凯乐科技	13,240	179,004.80	0.20
159	300296	利亚德	29,400	178,458.00	0.20
160	000564	供销大集	39,700	178,253.00	0.20
161	000878	云南铜业	16,800	178,248.00	0.20
162	600820	隧道股份	31,200	176,280.00	0.20
163	600704	物产中大	41,800	175,978.00	0.20
164	002670	国盛金控	19,200	175,680.00	0.20
165	600839	四川长虹	61,100	175,357.00	0.20
166	002368	太极股份	4,000	174,760.00	0.20
167	002081	金螳螂	22,200	174,492.00	0.20
168	600497	驰宏锌锗	50,500	173,720.00	0.20
169	300113	顺网科技	6,800	172,720.00	0.19
170	300166	东方国信	13,900	172,499.00	0.19
171	002124	天邦股份	13,400	172,190.00	0.19
172	600673	东阳光	24,900	172,059.00	0.19
173	002080	中材科技	11,100	172,050.00	0.19
174	300630	普利制药	2,300	170,085.00	0.19
175	600008	首创股份	56,400	169,764.00	0.19
176	600572	康恩贝	30,800	169,400.00	0.19
177	002221	东华能源	19,100	167,889.00	0.19
178	002920	德赛西威	2,700	165,591.00	0.19
179	000158	常山北明	15,800	164,952.00	0.19

180	600549	厦门钨业	13,900	164,576.00	0.19
181	300026	红日药业	29,800	164,496.00	0.18
182	600718	东软集团	14,300	164,450.00	0.18
183	601179	中国西电	33,900	164,076.00	0.18
184	000800	一汽解放	15,200	163,248.00	0.18
185	603866	桃李面包	3,200	162,848.00	0.18
186	002217	合力泰	30,900	162,225.00	0.18
187	603605	珀莱雅	900	162,018.00	0.18
188	600875	东方电气	18,300	161,955.00	0.18
189	600171	上海贝岭	9,300	161,634.00	0.18
190	300618	寒锐钴业	2,600	161,252.00	0.18
191	600021	上海电力	21,600	159,840.00	0.18
192	000729	燕京啤酒	23,300	159,605.00	0.18
193	601966	玲珑轮胎	7,900	159,580.00	0.18
194	002831	裕同科技	5,800	159,558.00	0.18
195	000877	天山股份	10,400	157,040.00	0.18
196	600567	山鹰纸业	53,200	156,940.00	0.18
197	600060	海信视像	12,900	156,735.00	0.18
198	600094	大名城	26,300	156,485.00	0.18
199	600881	亚泰集团	53,700	156,267.00	0.18
200	600862	中航高科	9,200	155,664.00	0.18
201	600160	巨化股份	22,300	153,647.00	0.17
202	000060	中金岭南	41,300	153,636.00	0.17
203	002399	海普瑞	6,100	152,744.00	0.17
204	600645	中源协和	5,400	152,550.00	0.17
205	002709	天赐材料	4,500	152,055.00	0.17
206	002056	横店东磁	13,500	151,875.00	0.17
207	600597	光明乳业	10,100	150,086.00	0.17
208	000090	天健集团	21,600	149,256.00	0.17
209	603228	景旺电子	4,220	148,501.80	0.17
210	002458	益生股份	9,700	148,119.00	0.17

211	002429	兆驰股份	29,900	148,005.00	0.17
212	600026	中远海能	22,874	147,766.04	0.17
213	300133	华策影视	20,300	147,175.00	0.17
214	600754	锦江酒店	5,300	147,075.00	0.17
215	603712	七一二	3,800	145,844.00	0.16
216	600580	卧龙电驱	12,900	144,996.00	0.16
217	601005	重庆钢铁	97,000	144,530.00	0.16
218	600967	内蒙一机	13,900	144,421.00	0.16
219	600273	嘉化能源	16,500	144,210.00	0.16
220	603568	伟明环保	6,200	143,840.00	0.16
221	002648	卫星石化	8,800	143,176.00	0.16
222	600392	盛和资源	20,300	143,115.00	0.16
223	000629	攀钢钒钛	71,000	142,710.00	0.16
224	600282	南钢股份	44,000	142,120.00	0.16
225	002233	塔牌集团	11,800	141,954.00	0.16
226	600755	厦门国贸	21,400	141,240.00	0.16
226	000960	锡业股份	16,500	141,240.00	0.16
228	002807	江阴银行	35,900	141,087.00	0.16
229	002004	华邦健康	26,200	140,956.00	0.16
230	002203	海亮股份	16,100	140,875.00	0.16
231	002085	万丰奥威	21,700	140,616.00	0.16
232	600039	四川路桥	36,700	140,194.00	0.16
233	600064	南京高科	14,300	138,996.00	0.16
234	601118	海南橡胶	28,300	137,538.00	0.15
235	600166	福田汽车	76,100	136,980.00	0.15
236	600737	中粮糖业	17,600	136,928.00	0.15
237	000970	中科三环	14,000	136,920.00	0.15
238	601975	招商南油	57,200	136,708.00	0.15
239	600195	中牧股份	8,400	136,332.00	0.15
240	000598	兴蓉环境	29,600	136,160.00	0.15
241	600563	法拉电子	2,200	135,960.00	0.15

242	000690	宝新能源	28,800	135,936.00	0.15
243	000778	新兴铸管	39,600	135,828.00	0.15
244	300182	捷成股份	34,000	135,660.00	0.15
245	300324	旋极信息	20,300	135,198.00	0.15
246	600566	济川药业	5,300	134,938.00	0.15
247	002110	三钢闽光	20,200	134,532.00	0.15
248	600466	蓝光发展	24,900	134,211.00	0.15
249	600515	海航基础	25,800	134,160.00	0.15
250	000400	许继电气	10,000	132,000.00	0.15
251	600373	中文传媒	11,200	131,936.00	0.15
252	002506	协鑫集成	50,400	131,544.00	0.15
253	002183	怡亚通	24,500	131,320.00	0.15
254	000402	金融街	19,700	130,808.00	0.15
255	603816	顾家家居	2,900	130,529.00	0.15
256	600435	北方导航	17,200	130,032.00	0.15
257	000967	盈峰环境	15,700	129,525.00	0.15
258	002635	安洁科技	5,200	129,480.00	0.15
259	000089	深圳机场	16,900	129,454.00	0.15
260	002745	木林森	8,400	129,444.00	0.15
261	002038	双鹭药业	10,100	129,381.00	0.15
262	002191	劲嘉股份	14,500	129,195.00	0.15
263	000738	航发控制	9,442	128,883.30	0.14
264	002092	中泰化学	28,400	128,652.00	0.14
265	000681	视觉中国	6,900	128,478.00	0.14
266	002595	豪迈科技	6,600	128,436.00	0.14
267	600643	爱建集团	16,100	127,995.00	0.14
268	300474	景嘉微	1,900	127,870.00	0.14
269	601860	紫金银行	30,200	127,746.00	0.14
270	002925	盈趣科技	2,200	127,468.00	0.14
271	601106	中国一重	45,300	127,293.00	0.14
272	000039	中集集团	17,600	127,248.00	0.14

273	600808	马钢股份	49,300	127,194.00	0.14
274	000983	西山煤电	33,880	127,050.00	0.14
275	002048	宁波华翔	8,200	126,608.00	0.14
276	600120	浙江东方	18,400	126,408.00	0.14
277	000930	中粮科技	18,500	126,355.00	0.14
278	601333	广深铁路	56,100	126,225.00	0.14
279	600633	浙数文化	12,900	126,162.00	0.14
280	000830	鲁西化工	16,900	126,074.00	0.14
281	000825	太钢不锈	37,700	125,164.00	0.14
282	600729	重庆百货	4,000	124,880.00	0.14
283	601098	中南传媒	11,800	124,844.00	0.14
284	600376	首开股份	21,300	124,818.00	0.14
285	600056	中国医药	8,800	124,520.00	0.14
286	600258	首旅酒店	8,100	124,497.00	0.14
287	600649	城投控股	20,900	124,146.00	0.14
288	600388	龙净环保	14,100	124,080.00	0.14
289	600675	中华企业	30,200	122,914.00	0.14
290	000415	渤海租赁	40,900	121,882.00	0.14
291	000563	陕国投 A	32,740	121,465.40	0.14
292	002372	伟星新材	10,400	120,952.00	0.14
293	601866	中远海发	65,601	120,705.84	0.14
294	601718	际华集团	36,300	120,516.00	0.14
295	002839	张家港行	20,900	120,384.00	0.14
296	002407	多氟多	11,300	120,232.00	0.14
297	300180	华峰超纤	14,000	119,840.00	0.13
298	600776	东方通信	7,900	119,211.00	0.13
299	000501	鄂武商 A	7,600	119,168.00	0.13
300	002815	崇达技术	5,800	117,334.00	0.13
301	002010	传化智联	21,500	116,960.00	0.13
302	002640	跨境通	18,000	116,820.00	0.13
303	600022	山东钢铁	90,500	116,745.00	0.13

304	002064	华峰氨纶	22,900	116,103.00	0.13
305	000012	南玻 A	23,100	115,962.00	0.13
306	603077	和邦生物	87,600	115,632.00	0.13
307	600500	中化国际	22,800	115,368.00	0.13
307	002583	海能达	15,200	115,368.00	0.13
309	000078	海王生物	27,400	114,806.00	0.13
310	000932	华菱钢铁	30,400	114,608.00	0.13
311	000883	湖北能源	32,300	113,696.00	0.13
312	600062	华润双鹤	8,600	113,692.00	0.13
313	601615	明阳智能	9,100	113,295.00	0.13
314	600266	城建发展	22,320	113,162.40	0.13
315	000959	首钢股份	26,200	112,660.00	0.13
316	000807	云铝股份	25,800	112,488.00	0.13
317	002375	亚厦股份	11,000	112,420.00	0.13
317	000685	中山公用	14,600	112,420.00	0.13
319	600316	洪都航空	7,100	112,180.00	0.13
320	603486	科沃斯	3,700	111,777.00	0.13
321	000301	东方盛虹	19,900	110,644.00	0.12
322	002936	郑州银行	32,010	110,114.40	0.12
323	000559	万向钱潮	22,700	109,868.00	0.12
324	002244	滨江集团	25,700	109,739.00	0.12
325	601699	潞安环能	19,700	109,729.00	0.12
326	002155	湖南黄金	13,900	109,532.00	0.12
327	000027	深圳能源	23,560	109,318.40	0.12
328	601000	唐山港	49,000	109,270.00	0.12
329	000488	晨鸣纸业	22,100	109,174.00	0.12
330	000519	中兵红箭	11,500	108,330.00	0.12
331	000028	国药一致	2,400	108,024.00	0.12
332	000031	大悦城	21,200	107,908.00	0.12
333	600782	新钢股份	26,300	107,304.00	0.12
334	000528	柳工	17,000	107,270.00	0.12

335	000987	越秀金控	9,100	106,106.00	0.12
336	600908	无锡银行	21,400	105,074.00	0.12
337	002444	巨星科技	8,800	104,544.00	0.12
338	002440	闰土股份	11,400	104,196.00	0.12
339	600640	号百控股	5,200	103,740.00	0.12
340	002625	光启技术	14,200	102,950.00	0.12
341	002266	浙富控股	26,600	102,942.00	0.12
342	600777	新潮能源	67,500	102,600.00	0.12
343	600073	上海梅林	10,800	102,492.00	0.12
344	000156	华数传媒	9,400	101,802.00	0.11
345	601717	郑煤机	17,200	101,308.00	0.11
346	300459	金科文化	29,300	101,085.00	0.11
347	002390	信邦制药	22,000	100,320.00	0.11
348	300072	三聚环保	23,300	99,724.00	0.11
349	600312	平高电气	13,400	99,428.00	0.11
350	601958	金钼股份	16,000	98,880.00	0.11
351	601608	中信重工	28,700	98,154.00	0.11
352	600291	西水股份	10,800	97,740.00	0.11
353	002701	奥瑞金	23,300	97,627.00	0.11
354	000898	鞍钢股份	39,600	97,020.00	0.11
355	000046	泛海控股	25,700	96,889.00	0.11
356	002424	贵州百灵	11,600	96,280.00	0.11
357	002434	万里扬	11,000	95,480.00	0.11
358	000758	中色股份	22,800	95,304.00	0.11
359	600409	三友化工	20,400	95,064.00	0.11
360	000887	中鼎股份	12,100	94,985.00	0.11
361	002505	大康农业	42,100	94,725.00	0.11
362	000008	神州高铁	32,200	94,668.00	0.11
363	600557	康缘药业	6,800	94,656.00	0.11
364	600863	内蒙华电	38,400	94,464.00	0.11
365	600765	中航重机	9,200	94,024.00	0.11

366	600138	中青旅	9,500	93,765.00	0.11
366	002563	森马服饰	13,300	93,765.00	0.11
368	601228	广州港	30,700	93,328.00	0.10
369	600751	海航科技	29,800	93,274.00	0.10
370	002589	瑞康医药	17,400	93,264.00	0.10
371	000712	锦龙股份	7,400	92,500.00	0.10
372	002002	鸿达兴业	25,600	92,416.00	0.10
373	600507	方大特钢	17,767	92,210.73	0.10
374	000813	德展健康	14,800	91,760.00	0.10
375	601880	大连港	53,300	91,676.00	0.10
376	600970	中材国际	17,200	90,816.00	0.10
377	600158	中体产业	11,100	90,798.00	0.10
378	601200	上海环境	7,500	90,000.00	0.10
379	600478	科力远	19,100	89,961.00	0.10
380	600835	上海机电	5,300	89,729.00	0.10
381	600639	浦东金桥	5,600	89,488.00	0.10
382	600545	卓郎智能	18,800	88,924.00	0.10
383	603885	吉祥航空	9,700	88,270.00	0.10
384	300134	大富科技	6,300	88,074.00	0.10
385	600717	天津港	19,920	88,046.40	0.10
386	000826	启迪环境	11,800	87,556.00	0.10
387	600259	广晟有色	2,900	87,000.00	0.10
388	002503	搜于特	30,700	86,267.00	0.10
389	600648	外高桥	6,100	86,254.00	0.10
390	601928	凤凰传媒	12,600	85,680.00	0.10
391	603198	迎驾贡酒	3,900	84,903.00	0.10
392	002249	大洋电机	23,400	84,474.00	0.09
393	600125	铁龙物流	15,100	84,258.00	0.09
394	601598	中国外运	26,000	83,980.00	0.09
395	600348	阳泉煤业	19,800	83,556.00	0.09
396	000732	泰禾集团	16,400	83,476.00	0.09

397	600823	世茂股份	18,600	83,142.00	0.09
398	000061	农产品	11,200	82,992.00	0.09
399	002665	首航高科	33,600	81,984.00	0.09
400	600329	中新药业	4,700	81,404.00	0.09
401	601611	中国核建	13,100	80,958.00	0.09
402	600582	天地科技	27,300	79,989.00	0.09
403	002867	周大生	3,600	79,812.00	0.09
404	600307	酒钢宏兴	51,800	79,772.00	0.09
405	002302	西部建设	8,300	79,680.00	0.09
406	300376	易事特	15,300	79,560.00	0.09
407	603377	东方时尚	4,800	79,488.00	0.09
408	000990	诚志股份	6,200	78,678.00	0.09
409	600748	上实发展	15,200	77,672.00	0.09
410	000718	苏宁环球	25,100	77,559.00	0.09
411	600901	江苏租赁	14,800	77,108.00	0.09
412	600664	哈药股份	24,800	76,384.00	0.09
413	600141	兴发集团	8,500	76,075.00	0.09
414	603888	新华网	3,400	76,024.00	0.09
415	000717	韶钢松山	20,000	76,000.00	0.09
416	600017	日照港	30,500	75,945.00	0.09
417	601678	滨化股份	17,800	75,472.00	0.08
418	002419	天虹股份	7,900	75,445.00	0.08
419	000543	皖能电力	18,700	75,174.00	0.08
420	000869	张裕 A	2,200	75,130.00	0.08
421	002544	杰赛科技	5,700	74,955.00	0.08
422	000848	承德露露	10,670	74,690.00	0.08
423	000062	深圳华强	5,100	74,154.00	0.08
424	600277	亿利洁能	22,600	73,676.00	0.08
425	002128	露天煤业	9,500	73,625.00	0.08
426	002093	国脉科技	8,300	73,455.00	0.08
427	002416	爱施德	10,200	73,236.00	0.08

428	600869	智慧能源	18,300	73,200.00	0.08
429	300257	开山股份	5,600	73,192.00	0.08
430	002408	齐翔腾达	11,700	72,657.00	0.08
431	002901	大博医疗	600	71,574.00	0.08
432	002948	青岛银行	13,600	69,224.00	0.08
433	002653	海思科	2,600	69,186.00	0.08
434	603328	依顿电子	6,600	68,838.00	0.08
435	300197	铁汉生态	27,100	68,834.00	0.08
436	603515	欧普照明	2,500	68,425.00	0.08
437	000553	安道麦A	7,500	67,650.00	0.08
438	603650	彤程新材	2,900	67,483.00	0.08
439	600565	迪马股份	24,100	67,239.00	0.08
440	000537	广宇发展	9,200	67,160.00	0.08
441	603766	隆鑫通用	16,900	65,403.00	0.07
442	601019	山东出版	10,300	64,375.00	0.07
443	002491	通鼎互联	12,500	64,000.00	0.07
444	600787	中储股份	14,500	63,655.00	0.07
445	603056	德邦股份	4,700	63,591.00	0.07
446	600350	山东高速	10,300	63,242.00	0.07
447	600339	中油工程	27,700	62,879.00	0.07
448	600053	九鼎投资	2,100	62,664.00	0.07
449	600770	综艺股份	12,900	61,920.00	0.07
450	601139	深圳燃气	9,500	61,750.00	0.07
451	002470	金正大	27,200	61,744.00	0.07
452	601869	长飞光纤	2,000	61,620.00	0.07
453	603983	丸美股份	700	60,221.00	0.07
454	000600	建投能源	11,800	60,062.00	0.07
455	600338	西藏珠峰	6,000	60,000.00	0.07
456	002051	中工国际	8,100	58,968.00	0.07
457	601016	节能风电	27,500	58,300.00	0.07
458	600657	信达地产	14,100	58,092.00	0.07

459	603317	天味食品	1,040	57,803.20	0.06
460	600694	大商股份	2,400	57,576.00	0.06
461	002118	紫鑫药业	12,700	56,388.00	0.06
462	002285	世联行	20,200	56,358.00	0.06
463	600985	淮北矿业	7,100	55,309.00	0.06
464	600428	中远海特	17,700	54,516.00	0.06
465	601801	皖新传媒	9,800	54,488.00	0.06
466	600707	彩虹股份	11,800	53,808.00	0.06
467	600575	淮河能源	25,700	53,713.00	0.06
468	600006	东风汽车	13,200	53,196.00	0.06
469	000937	冀中能源	17,500	52,850.00	0.06
470	603786	科博达	700	52,745.00	0.06
471	600757	长江传媒	10,000	50,900.00	0.06
472	601865	福莱特	2,700	50,760.00	0.06
473	600996	贵广网络	6,869	48,975.97	0.06
474	600623	华谊集团	9,200	47,472.00	0.05
475	600874	创业环保	7,100	47,144.00	0.05
476	603556	海兴电力	3,200	46,208.00	0.05
477	002941	新疆交建	3,200	45,280.00	0.05
478	600058	五矿发展	7,000	42,280.00	0.05
479	000785	居然之家	4,900	38,808.00	0.04
480	601003	柳钢股份	8,400	37,212.00	0.04
481	002946	新乳业	2,100	36,435.00	0.04
482	600903	贵州燃气	3,700	36,408.00	0.04
483	000025	特力A	1,900	34,827.00	0.04
484	603868	飞科电器	700	34,531.00	0.04
485	601127	小康股份	4,100	34,071.00	0.04
486	600335	国机汽车	7,200	33,264.00	0.04
487	603355	莱克电气	1,300	32,357.00	0.04
488	601969	海南矿业	6,400	31,232.00	0.04
489	601512	中新集团	2,700	31,050.00	0.03

490	002818	富森美	2,500	30,750.00	0.03
491	603379	三美股份	1,360	29,199.20	0.03
492	603225	新凤鸣	2,700	26,946.00	0.03
493	601811	新华文轩	2,600	26,442.00	0.03
494	002423	中粮资本	3,000	26,100.00	0.03
495	001872	招商港口	1,700	24,735.00	0.03
496	603025	大豪科技	3,000	21,810.00	0.02
497	600917	重庆燃气	3,000	21,420.00	0.02
498	601068	中铝国际	5,000	19,550.00	0.02
499	603256	宏和科技	1,500	17,160.00	0.02
500	002957	科瑞技术	600	14,340.00	0.02

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002821	凯莱英	2,648,561.00	2.40
2	002371	北方华创	1,952,374.64	1.77
3	300088	长信科技	1,911,916.00	1.73
4	002384	东山精密	1,867,391.00	1.69
5	300014	亿纬锂能	1,790,130.00	1.62
6	002463	沪电股份	1,736,474.00	1.57
7	002065	东华软件	1,653,173.00	1.50
8	002129	中环股份	1,631,178.00	1.48
9	000066	中国长城	1,622,081.00	1.47
10	300383	光环新网	1,567,948.00	1.42
11	002439	启明星辰	1,566,629.00	1.42
12	002812	恩捷股份	1,564,131.00	1.41

13	000750	国海证券	1,544,706.50	1.40
14	300253	卫宁健康	1,527,879.00	1.38
15	002180	纳思达	1,513,971.00	1.37
16	002340	格林美	1,496,180.00	1.35
17	002049	紫光国微	1,400,233.50	1.27
18	300207	欣旺达	1,382,896.00	1.25
19	002465	海格通信	1,330,565.00	1.20
20	300012	华测检测	1,312,702.00	1.19

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002821	凯莱英	2,921,269.20	2.64
2	002371	北方华创	2,802,378.00	2.53
3	300014	亿纬锂能	2,743,711.68	2.48
4	002384	东山精密	2,613,095.00	2.36
5	002463	沪电股份	2,572,560.31	2.33
6	002129	中环股份	2,437,816.00	2.21
7	000066	中国长城	2,221,369.00	2.01
8	300383	光环新网	2,209,701.00	2.00
9	002049	紫光国微	2,141,319.00	1.94
10	002065	东华软件	2,029,907.00	1.84
11	002812	恩捷股份	2,020,097.10	1.83
12	002180	纳思达	1,904,049.97	1.72
13	300253	卫宁健康	1,887,657.20	1.71
14	300088	长信科技	1,830,209.46	1.66
15	300529	健帆生物	1,783,596.22	1.61
16	002439	启明星辰	1,682,617.37	1.52
17	000750	国海证券	1,631,558.00	1.48

18	002465	海格通信	1,542,465.63	1.40
19	002127	南极电商	1,511,698.69	1.37
20	002340	格林美	1,480,660.00	1.34

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	196,865,895.22
卖出股票收入（成交）总额	214,521,459.46

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2007	中证500股指期货2007合约	2	2,319,760.00	131,680.00	-
IC2009	中证500股指期货	5	5,664,400.	344,760.00	-

	货2009合约		00		
公允价值变动总额合计（元）					476,440.00
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					476,440.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除卫宁健康(300253)外其他证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**上海市浦东新区国家税务局第十六税务所2020年7月3日发布对卫宁健康科技集团股份有限公司进行处罚（沪国税浦十六简罚[2017]681号）。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作。对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，上述证券系标的指数成份股，因复制指数而被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

**7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,112,539.16
2	应收证券清算款	17,073.20
3	应收股利	-
4	应收利息	1,537.01

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,131,149.37

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
452	166,694.03	67,580,170.00	89.69%	7,765,530.00	10.31%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月15日)基金份额总额	235,345,700.00
本报告期期初基金份额总额	105,345,700.00
本报告期基金总申购份额	224,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	254,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,345,700.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2020年2月7日发布公告，王启道先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

本基金管理人于2020年2月13日发布公告，黄言先生担任中融基金管理有限公司常务副总裁。

本基金管理人于2020年4月10日发布公告，易海波先生因个人原因提出离职，不再担任中融基金管理有限公司副总裁。

公司其他高管人员未变动。

#### (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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	66,035,457.09	16.09%	48,291.33	16.09%	-
广发证券	2	306,026,520.66	74.57%	223,798.41	74.57%	-
申万宏源	2	38,353,757.75	9.35%	28,048.46	9.35%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-13
2	关于中融基金管理有限公司调整中融中证500交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
3	中融基金管理有限公司关于中融中证500交易型开放式指数证券投资基金投资于科创板股票相关风险提示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
4	中融基金管理有限公司关于中融中证500交易型开放式指数证券投资基金调整指数许可使用费及相关法律文件修改的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
5	中融基金管理有限公司关于因2020年春节假期延长调整旗下基金相关业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31
6	中融基金管理有限公司关于公司自有资金及高级管理人员投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-06
7	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-07
8	中融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-13
9	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-21
10	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金产品增加扩位证券简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-14
11	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-17
12	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
13	中融基金管理有限公司关于旗下基金在泰诚财富基金销售(大连)有限公司暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
14	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-23

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101--20200102	21,324,170.00	675,830.00	22,000,000.00	0.00	0.00%
	2	20200115--20200630	0.00	224,532,500.00	158,286,400.00	66,246,100.00	87.92%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所或基金托管人的住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，(010) 56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十八日