

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
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	96
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	96

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	96
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	96
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.12 投资组合报告附注	97
§9 基金份额持有人信息	99
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
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	99
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	100
§10 开放式基金份额变动	101
§11 重大事件揭示	102
11.1 基金份额持有人大会决议	102
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	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	102
11.4 基金投资策略的改变	102
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	102
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	102
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	103
11.8 其他重大事件	104
§12 影响投资者决策的其他重要信息	111
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	111
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	111
§13 备查文件目录	112
13.1 备查文件目录	112
13.2 存放地点	112
13.3 查阅方式	112

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金沪深 300	
基金主代码	003015	
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	201,428,657.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码:	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	96,394,245.33 份	105,034,412.10 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，在力求对沪深 300 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	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券

	型基金与货币市场基金。
--	-------------

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	中金沪深 300A	中金沪深 300C	中金沪深 300A	中金沪深 300C
本期 已实 现收 益	32,855,251. 15	43,834,459. 91	5,958,225.9 6	1,996,957.4 9	-2,275,304. 51	-281,193.8 0
本期 利润	45,080,430. 86	52,839,517. 38	10,317,433. 96	3,892,633.3 4	-3,648,076. 65	-334,963.3 3
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.6576	0.6820	0.1831	0.3134	-0.2647	-0.2774
本期 加权 平均 净值 利润 率	41.81%	39.91%	15.03%	24.53%	-23.79%	-25.50%
本期 基金	46.44%	45.84%	36.66%	38.71%	-19.85%	-19.75%

份额 净值 增长率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末 可供 分配 利润	66,808,120. 46	76,364,816. 82	14,311,114. 62	12,520,130. 96	-615,072.45	-48,718.79
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.6931	0.7270	0.2394	0.2698	-0.0323	-0.0234
期末 基金 资产 净值	186,687,694 .88	207,511,039 .25	79,053,881. 19	62,857,317. 81	18,418,213. 93	2,037,479. 69
期末 基金 份额 净值	1.9367	1.9756	1.3225	1.3546	0.9677	0.9766
3.1. 3 累计	2020 年末		2019 年末		2018 年末	

期末 指标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	93.67%	85.64%	32.25%	35.46%	-3.23%	-8.23%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润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

中金沪深 300A

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	14.29%	0.95%	12.90%	0.94%	1.39%	0.01%
过去六个月	32.19%	1.29%	23.83%	1.28%	8.36%	0.01%
过去一年	46.44%	1.38%	25.86%	1.36%	20.58%	0.02%
过去三年	60.42%	1.24%	28.11%	1.28%	32.31%	-0.04%
自基金合同生效起至今	93.67%	1.08%	57.17%	1.11%	36.50%	-0.03%

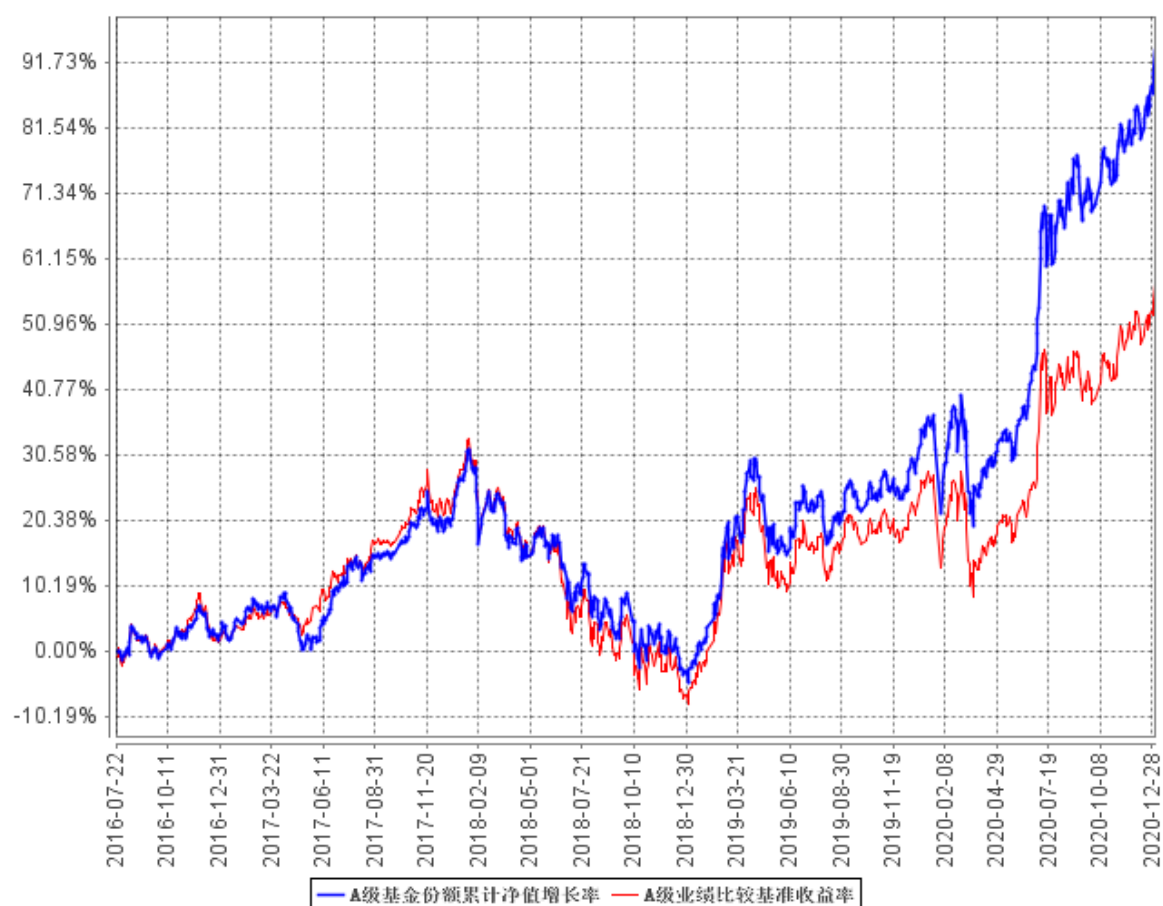
中金沪深 300C

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	14.17%	0.95%	12.90%	0.94%	1.27%	0.01%

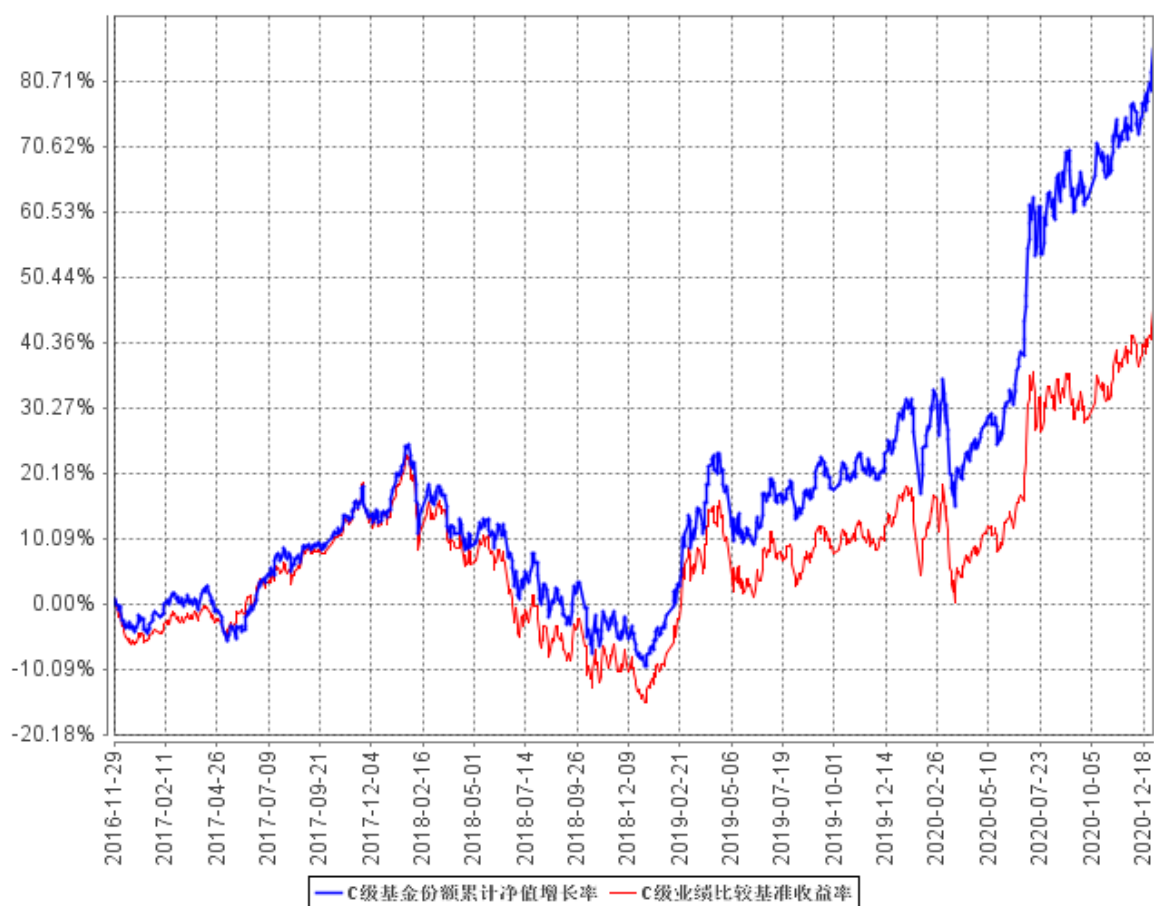
过去六个月	31.92%	1.29%	23.83%	1.28%	8.09%	0.01%
过去一年	45.84%	1.38%	25.86%	1.36%	19.98%	0.02%
过去三年	62.35%	1.24%	28.11%	1.28%	34.24%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	85.64%	1.11%	57.17%	1.14%	28.47%	-0.03%

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

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

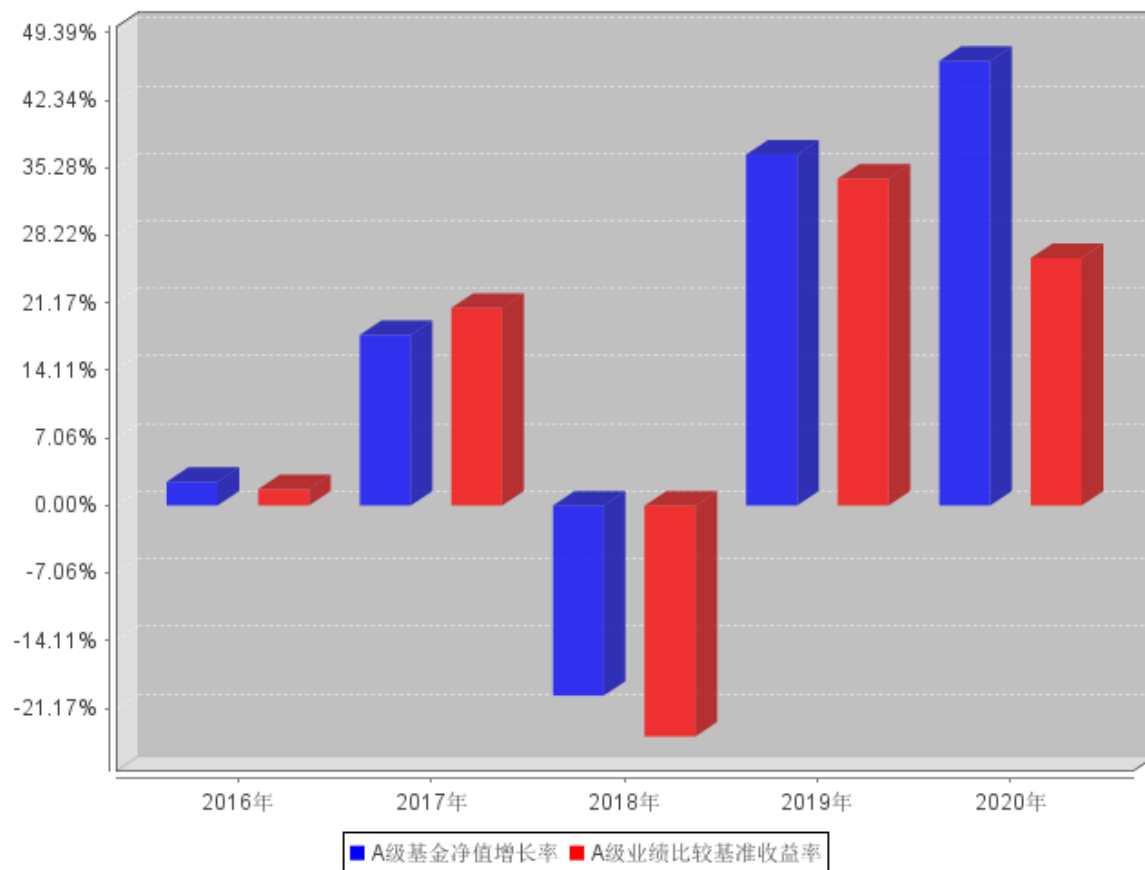


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

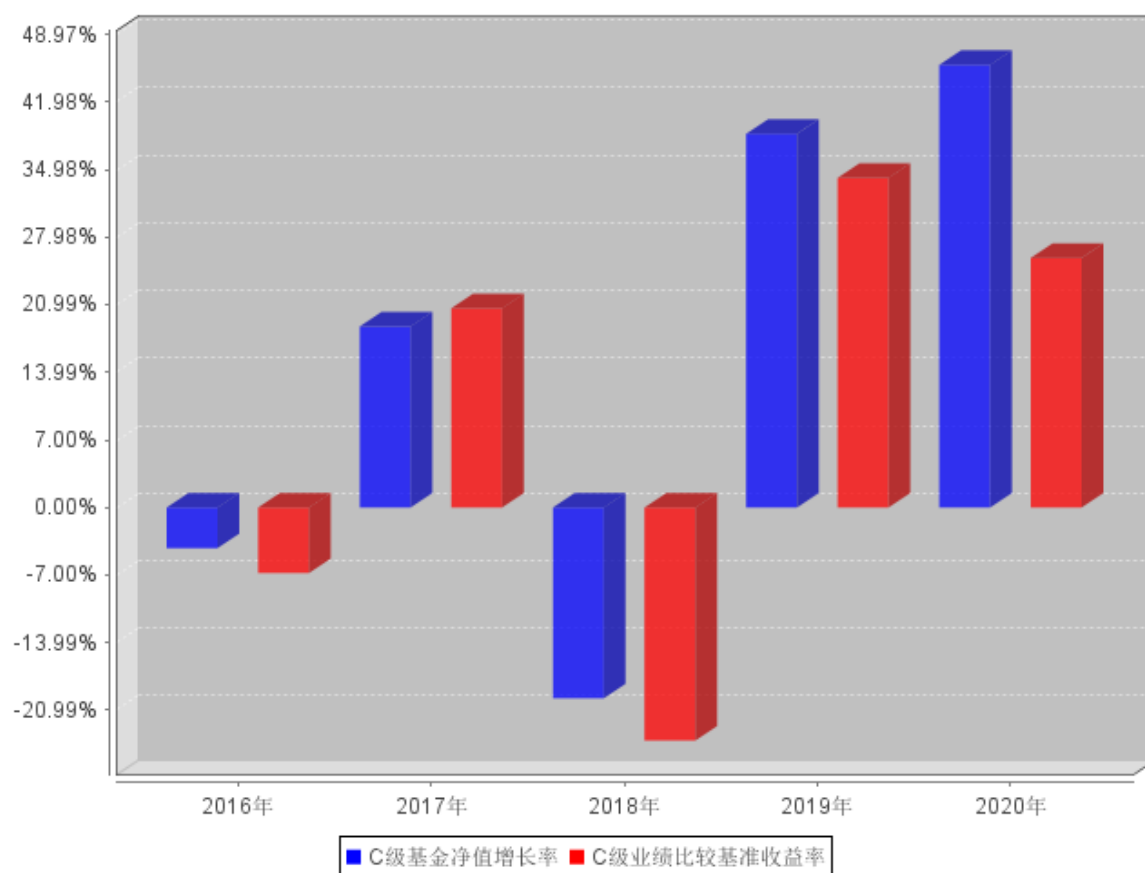


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家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 2020 年 12 月 31 日，公司共管理 37 只开放式基金，证券投资基金管理规模 539.94 亿。

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	—	10 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，现任量化投资部基金经理。
耿帅军	本基金的基金经理	2020 年 10 月 29 日	—	9 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有

					限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。2020 年 8 月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

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《证券业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，本基金采用量化选股的方法以获取超越业绩基准的收益。2020 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。

2020 年一季度，突发疫情在全球扩散，打断了 2019 年末全球共振复苏的路径。主要央行联手应对、快速响应，有效缓释了恐慌情绪造成的流动性危机。为对冲疫情产生的负面影响，全球主要经济体普遍推出了强劲财政刺激计划，增加了市场对疫情过后经济增长恢复的信心。中国在疫情防控、复工复产等方面措施得当，经济增长水平在全球主要经济体中居于前列，国内生产及需求景气水平正逐步恢复至疫情前水平。A 股市场在一季度受疫情影响出现明显调整。此后，随着财政、金融政策的推出，以及国内生产需求景气度的回升，市场行情快速回暖。全年来看，主要指数均收获了不同程度上涨，沪深 300 指数、中证 500 指数、中证 800 指数、中证 1000 指数分别上涨 27.21%、20.87%、25.79%和 19.39%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 1.9367 元，本报告期基金份额净值增长率为 46.44%；截至本报告期末中金沪深 300C 基金份额净值为 1.9756 元，本报告期基金份额净值增长率为 45.84%；同期业绩比较基准收益率为 25.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于经历了连续两年不俗表现的 A 股市场，2021 年或是一个不乏结构性机会的相对中性年份。从宏观增长看，尽管全球大部分发达经济体仍然面临疫情反复、内部结构性矛盾等负面压力，但随着疫苗推广所带来的疫情相对缓解、财政货币政策效果显现等，全球经济在 2020 年低基数基础上或有一定增长；中国在疫情控制、产能恢复、消费复苏等多方面均有明显优势，2021 年增长前

景依然可期。流动性方面，为支持经济恢复，海外主要发达经济体宏观流动性整体上仍维持宽松基调；国内政策环境已开始逐步回归正常化，宏观流动性较去年边际收紧，但应不会“急转弯”，考虑到基金发行、外资流入等微观流动性因素，市场整体或有结构性机会。以下两方面值得关注：一是反映中国经济消费升级、产业升级等长期趋势的泛消费、高端制造、研发创新等产业相关的战略配置机会；二是全球经济复苏、实体需求增加所带动的顺周期、低估值板块的阶段性投资机会。如果抛开周期性波动，以长期战略配置视角看待中国资本市场的结构性变化，机构化、国际化等长线趋势对 A 股的市场生态、投资行为等影响深远，重视基本面变化、关注配置价值的价值投资、长期投资理念将使得基本面高质量的大盘蓝筹公司依然是中长线资金的战略配置标的。

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，组织落实《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及配套规则，持续对基金宣传推介材料、销售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，有序执行《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时、规范。6) 以中国证监会《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中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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金沪深 300 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中金沪深 300 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沪深 300 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。

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沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2020 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 2102118 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	中金沪深 300 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	我们审计了后附的中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“中金沪深 300 基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 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。 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，公允反映了中金沪深 300 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“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，我们独立于中金沪深 300 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。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	中金沪深 300 基金管理人中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中金沪深 300 基

	金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中金沪深 300 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，除非中金沪深 300 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中金沪深 300 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗

	漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金沪深 300 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沪深 300 基金不能持续经营。 (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。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	李瑞丛
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	6,663,550.27	2,507,026.48
结算备付金		5,037,722.03	1,219,502.99
存出保证金		152,105.33	118,874.11
交易性金融资产	7.4.7.2	388,059,571.12	143,268,389.80
其中：股票投资		369,446,921.12	133,707,731.20
基金投资		-	-
债券投资		18,612,650.00	9,560,658.60
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		2,887,447.33	641,734.08
应收利息	7.4.7.5	261,428.04	132,127.36
应收股利		-	-
应收申购款		755,371.05	280,883.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		403,817,195.17	148,168,538.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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		2,000,000.00	4,100,000.00
应付证券清算款		4,763,264.45	-
应付赎回款		505,649.98	1,620,521.04
应付管理人报酬		150,225.01	60,359.85
应付托管费		45,067.52	18,107.98
应付销售服务费		66,176.24	22,309.62
应付交易费用	7.4.7.7	1,954,370.03	386,037.56
应交税费		1.82	0.22
应付利息		-1,444.93	-354.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	135,150.92	50,358.48
负债合计		9,618,461.04	6,257,339.77
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	201,428,657.43	106,180,041.13
未分配利润	7.4.7.10	192,770,076.70	35,731,157.87
所有者权益合计		394,198,734.13	141,911,199.00
负债和所有者权益总计		403,817,195.17	148,168,538.77

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.9367 元，基金份额总额 96,394,245.33 份；C 类基金份额净值 1.9756 元，基金份额总额 105,034,412.10 份。总份额合计 201,428,657.43 份。

7.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 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
-----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		107,206,611.87	16,825,014.79
1.利息收入		406,252.36	128,609.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	62,000.20	41,005.97
债券利息收入		343,897.69	86,410.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,193.63
证券出借利息收入		354.47	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		85,325,073.74	9,698,651.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	81,986,122.86	8,386,701.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	101,363.11	-57,227.95
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,237,587.77	1,369,178.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	21,230,237.18	6,254,883.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	245,048.59	742,869.06
减：二、费用		9,286,663.63	2,614,947.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,186,329.95	412,297.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	355,898.99	123,689.34
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	521,648.96	60,822.90
4. 交易费用	7.4.7.18	6,912,907.82	1,907,928.29

5. 利息支出		97,757.85	44,894.46
其中：卖出回购金融资产支出		97,757.85	44,894.46
6. 税金及附加		0.44	0.21
7. 其他费用	7.4.7.19	212,119.62	65,314.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		97,919,948.24	14,210,067.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		97,919,948.24	14,210,067.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	106,180,041.13	35,731,157.87	141,911,199.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,919,948.24	97,919,948.24
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）	95,248,616.30	59,118,970.59	154,367,586.89
其中：1. 基金申购款	324,189,164.12	200,746,459.86	524,935,623.98
2. 基金赎回款	-228,940,547.82	-141,627,489.27	-370,568,037.09
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）	201,428,657.43	192,770,076.70	394,198,734.13
项目	上年度可比期间		
	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）	21,119,484.86	-663,791.24	20,455,693.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,210,067.30	14,210,067.30
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）	85,060,556.27	22,184,881.81	107,245,438.08
其中：1. 基金申购款	276,974,096.73	66,935,798.73	343,909,895.46
2. 基金赎回款	-191,913,540.46	-44,750,916.92	-236,664,457.38
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）	106,180,041.13	35,731,157.87	141,911,199.00

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

中金沪深 300 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]1516 号《关于准予中金沪深 300 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《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）及中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”，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，《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2016 年 7 月 22 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,001,300.00 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。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金沪深 300 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，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转

债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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 2020 年 12 月 31 日的财务状况、2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-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：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

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

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

转融通利息收入是按本基金通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券的期限和相应转融通费率计算确认。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

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

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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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。

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

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

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

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

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	6,663,550.27	2,507,026.48
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：	6,663,550.27	2,507,026.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	343,317,768.75	369,446,921.12	26,129,152.37
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—

债券	交易所市场	18,642,236.46	18,612,650.00	-29,586.46
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,642,236.46	18,612,650.00	-29,586.46
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		361,960,005.21	388,059,571.12	26,099,565.91
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		128,898,818.89	133,707,731.20	4,808,912.31
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,500,242.18	9,560,658.60	60,416.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,500,242.18	9,560,658.60	60,416.42
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		138,399,061.07	143,268,389.80	4,869,328.73

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	989.71	456.78
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	2,492.71	603.68
应收债券利息	257,791.83	131,008.05
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	78.44	—
其他	75.35	58.85
合计	261,428.04	132,127.36

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,954,370.03	386,037.56
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	1,954,370.03	386,037.56

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	358.48
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	120,000.00	40,000.00
指数使用费	15,150.92	10,000.00
合计	135,150.92	50,358.48

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金沪深 300A		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,776,219.76	59,776,219.76
本期申购	81,761,996.68	81,761,996.68
本期赎回（以“-”号填列）	-45,143,971.11	-45,143,971.11
- 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	96,394,245.33	96,394,245.33

金额单位：人民币元

中金沪深 300C		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,403,821.37	46,403,821.37

本期申购	242,427,167.44	242,427,167.44
本期赎回（以“-”号填列）	-183,796,576.71	-183,796,576.71
- 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	105,034,412.10	105,034,412.10

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金沪深 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,311,114.62	4,966,546.81	19,277,661.43
本期利润	32,855,251.15	12,225,179.71	45,080,430.86
本期基金份额交易产生的变动数	19,641,754.69	6,293,602.57	25,935,357.26
其中：基金申购款	37,246,966.39	9,934,182.21	47,181,148.60
基金赎回款	-17,605,211.70	-3,640,579.64	-21,245,791.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,808,120.46	23,485,329.09	90,293,449.55

单位：人民币元

中金沪深 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,520,130.96	3,933,365.48	16,453,496.44
本期利润	43,834,459.91	9,005,057.47	52,839,517.38
本期基金份额交易产生的变动数	20,010,225.95	13,173,387.38	33,183,613.33
其中：基金申购款	113,780,220.68	39,785,090.58	153,565,311.26
基金赎回款	-93,769,994.73	-26,611,703.20	-120,381,697.93

本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,364,816.82	26,111,810.33	102,476,627.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
活期存款利息收入	23,887.65	29,239.97
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	36,673.74	11,105.89
其他	1,438.81	660.11
合计	62,000.20	41,005.97

注：其他为存出保证金利息收入。

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 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	2,563,167,558.92	685,838,357.27
减：卖出股票成本总额	2,481,181,436.06	677,451,655.94
买卖股票差价收入	81,986,122.86	8,386,701.33

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 2020年1月1日至2020	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	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	101,363.11	-57,227.95
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	101,363.11	-57,227.95

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 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	24,107,188.21	10,622,658.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	23,528,620.32	10,456,174.83
减：应收利息总额	477,204.78	223,711.62
买卖债券差价收入	101,363.11	-57,227.95

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,237,587.77	1,369,178.57
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,237,587.77	1,369,178.57

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	21,230,237.18	6,254,883.85
——股票投资	21,320,240.06	6,192,587.43
——债券投资	-90,002.88	62,296.42
——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	21,230,237.18	6,254,883.85

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	238,035.33	741,388.21
基金转换费收入	7,013.26	1,480.85
合计	245,048.59	742,869.06

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,912,907.82	1,907,928.29
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	—	—
合计	6,912,907.82	1,907,928.29

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	10,000.00
证券出借违约金	—	—
公证费	8,000.00	—
律师费用	30,000.00	—

指数使用费	49,141.25	22,102.55
汇划手续费	4,978.37	3,211.87
合计	212,119.62	65,314.42

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

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

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、中金公司全资子公司中金私募股权投资管理有限公司于 2020 年 10 月 30 日成立，自同日起为本基金的关联方。除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方未发生变化。

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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	710,164,163.62	13.55%	686,653,429.92	46.80%
中金财富证券	1,627,119,826.46	31.04%	291,631,223.44	19.88%

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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	188,015.80	0.34%	16,520,399.10	56.53%
中金财富证券	22,033,180.30	39.98%	1,584,172.10	5.42%

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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	105,400,000.00	11.22%	184,200,000.00	45.26%
中金财富证券	377,800,000.00	40.21%	77,900,000.00	19.14%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中金公司	519,345.86	13.55%	203,670.74	10.42%
中金财富证券	1,189,915.27	31.04%	610,858.20	31.26%
关联方名称	上年度可比期间			
	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	502,149.18	46.80%	185,209.00	47.98%
中金财富证券	213,269.09	19.88%	91,869.63	23.80%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,186,329.95	412,297.87
其中：支付销售机构的客户维护费	223,359.46	39,081.14

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	355,898.99	123,689.34

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	231,973.06	231,973.06

中金公司	-	15,304.64	15,304.64
中金财富证券	-	9,198.52	9,198.52
合计	-	256,476.22	256,476.22
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	6,610.31	6,610.31
中金公司	-	119.70	119.70
中金财富证券	-	26,875.24	26,875.24
合计	-	33,605.25	33,605.25

注：本基金仅针对 C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中金公司	2,865,900.00	354.47	1,854,200.00	78.44

注：本基金上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
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	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
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	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	-
-------------------------	---------	---

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	6,663,550.27	23,887.65	2,507,026.48	29,239.97

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 2020 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 5,187,827.36 元(2019 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,338,377.10 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

金额单位：人民币元

本期					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中金公司	688365	光云科技	网下	5,458	58,946.40
中金公司	300831	派瑞股份	网下	1,716	6,829.68
中金公司	688505	复旦张江	网下	5,732	51,301.40
中金公司	688520	神州细胞	网下	3,019	77,407.16
中金公司	688180	君实生物	网下	2,193	121,711.50
中金公司	688165	埃夫特	网下	9,997	63,480.95
中金公司	688981	中芯国际	网下	34,664	951,873.44
中金公司	688256	寒武纪	网下	1,309	84,286.51

中金公司	688338	赛科希德	网下	2,854	143,698.90
中金公司	688185	康希诺	网下	1,306	273,881.26
中金公司	300866	安克创新	网下	3,127	207,382.64
中金公司	688301	奕瑞科技	网下	1,408	168,396.80
中金公司	003010	若羽臣	网下	562	8,542.40
中金公司	603565	中谷物流	网下	1,250	27,737.50
中金公司	300999	金龙鱼	网下	20,289	521,427.30
中金公司	003012	东鹏控股	网下	2,278	25,855.30
中金公司	300901	中胤时尚	网下	9,611	86,114.56
中金公司	003022	联泓新科	网下	2,304	26,403.84
中金公司	688617	惠泰医疗	网下	1,204	89,649.84

注：本基金上年度可比期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2020 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
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	74.46	74.46	1,204	89,649.84	89,649.84	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-

605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股未上市	4.59	5.46	125,280	575,035.20	684,028.80	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	78.49	170.53	1,282	100,624.18	218,619.46	-
688559	海目星	2020 年 8 月 28 日	2021 年 3 月 9 日	新股流通受限	14.56	30.97	5,924	86,253.44	183,466.28	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股流通受限	25.70	88.29	2,029	52,145.30	179,140.41	-
688127	蓝特光学	2020 年 9 月 14 日	2021 年 3 月	新股流通受限	15.41	33.60	5,322	82,012.02	178,819.20	-

		日	22 日							
688155	先惠技术	2020 年 8 月 3 日	2021 年 2 月 18 日	新股流通受限	38.77	67.26	2,403	93,164.31	161,625.78	-
688338	赛科希德	2020 年 7 月 27 日	2021 年 2 月 8 日	新股流通受限	50.35	54.59	2,854	143,698.90	155,799.86	-
688519	南亚新材	2020 年 8 月 10 日	2021 年 2 月 18 日	新股流通受限	32.60	30.51	5,079	165,575.40	154,960.29	-
688386	泛亚微透	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流通受限	16.28	47.41	3,217	52,372.76	152,517.97	-
300901	中胤时尚	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	8.96	15.00	9,611	86,114.56	144,165.00	-
688580	伟思医疗	2020 年 7 月 10 日	2021 年 1 月 21 日	新股流通受限	67.58	98.41	1,086	73,391.88	106,873.26	-
688219	会通股份	2020 年 11 月 6 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	8.29	13.70	7,336	60,815.44	100,503.20	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	11.33	16.34	4,950	56,083.50	80,883.00	-
688585	上纬新材	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688309	恒誉	2020 年	2021	新股流	24.79	32.53	1,810	44,869.90	58,879.30	-

	环保	7月7日	年1月14日	通受限						
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300894	火星	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	43.76	51.10	424	18,554.24	21,666.40	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	24.60	61.51	342	8,413.20	21,036.42	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股流通受限	30.26	47.87	415	12,557.90	19,866.05	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	138.02	126.67	140	19,322.80	17,733.80	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-

300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流 通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 30 日	新股流 通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新股流 通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股流 通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股流 通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月	新股流 通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-

		日	25 日							
300907	康平科技	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新股流 通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新股流 通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流 通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300881	盛德鑫泰	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 5 日	新股流 通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流 通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流 通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020 年 12 月 15 日	2021 年 1 月 15 日	新债未上市	100.00	100.00	7,280	728,000.00	728,000.00	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，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 2,000,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：张)	期末估值总额
2020123000001283	000333	美的集团	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 6 日	98.44	10,000	984,400.00

2020123000002940	601318	中 国 平安	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 2 日	86.98	10,000	869,800.00
合计						20,000	1,854,200.00

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	728,000.00	1,866,008.60
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	728,000.00	1,866,008.60

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人

管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在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 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,663,550.27	-	-	-	6,663,550.27
结算备付金	5,035,722.03	-	-	2,000.00	5,037,722.03
存出保证金	152,105.33	-	-	-	152,105.33
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	369,446,921.12	369,446,921.12
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	17,884,650.00	-	728,000.00	-	18,612,650.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,887,447.33	2,887,447.33
应收利息	-	-	-	261,428.04	261,428.04

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	755,371.05	755,371.05
资产总计	29,736,027.63	-	728,000.00	373,353,167.54	403,817,195.17
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	4,763,264.45	4,763,264.45
应付赎回款	-	-	-	505,649.98	505,649.98
应付管理人 报酬	-	-	-	150,225.01	150,225.01
应付托管费	-	-	-	45,067.52	45,067.52
应付交易费 用	-	-	-	1,954,370.03	1,954,370.03
应付销售服 务费	-	-	-	66,176.24	66,176.24
应交税费	-	-	-	1.82	1.82
应付利息	-	-	-	-1,444.93	-1,444.93
其他负债	-	-	-	135,150.92	135,150.92
负债总计	2,000,000.00	-	-	7,618,461.04	9,618,461.04
利率敏感度 缺口	27,736,027.63	-	728,000.00	365,734,706.50	394,198,734.13
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	2,507,026.48	-	-	-	2,507,026.48
结算备付金	1,219,502.99	-	-	-	1,219,502.99
存出保证金	118,874.11	-	-	-	118,874.11
交易性金融 资产-股票投 资	-	-	-	133,707,731.20	133,707,731.20
交易性金融 资产-债券投 资、资产支持 证券	7,694,650.00	1,046,708.60	819,300.00	-	9,560,658.60
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	641,734.08	641,734.08
应收利息	-	-	-	132,127.36	132,127.36
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	280,883.95	280,883.95
资产总计	11,540,053.58	1,046,708.60	819,300.00	134,762,476.59	148,168,538.77

负债					
卖出回购金融资产款	4,100,000.00	-	-	-	4,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,620,521.04	1,620,521.04
应付管理人报酬	-	-	-	60,359.85	60,359.85
应付托管费	-	-	-	18,107.98	18,107.98
应付交易费用	-	-	-	386,037.56	386,037.56
应付销售服务费	-	-	-	22,309.62	22,309.62
应交税费	-	-	-	0.22	0.22
应付利息	-	-	-	-354.98	-354.98
其他负债	-	-	-	50,358.48	50,358.48
负债总计	4,100,000.00	-	-	2,157,339.77	6,257,339.77
利率敏感度缺口	7,440,053.58	1,046,708.60	819,300.00	132,605,136.82	141,911,199.00

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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	15,534.28	9,582.05
	市场利率上升 25 个基点	-15,534.28	-9,582.05

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 2020 年 12 月 31 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	369,446,921.12	93.72	133,707,731.20	94.22
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	18,612,650.00	4.72	9,560,658.60	6.74
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	388,059,571.12	98.44	143,268,389.80	100.96

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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	19,761,840.82	6,659,012.33
	业绩比较基准下降 5%	-19,761,840.82	-6,659,012.33

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) 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

(a) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 364,366,639.53 元，属于第二层次的余额为 22,785,965.80 元，属于第三层次的余额为 906,965.79 元。(2019 年 12 月 31 日：第一层次 134,774,259.31 元，第二层次 8,347,213.28 元，第三层次 146,917.21 元)。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

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。

本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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(2019 年 12 月 31 日：无)。

(4) 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	369,446,921.12	91.49
	其中：股票	369,446,921.12	91.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,612,650.00	4.61
	其中：债券	18,612,650.00	4.61
	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	11,701,272.30	2.90
8	其他各项资产	4,056,351.75	1.00
9	合计	403,817,195.17	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 1,854,200.00 元，占期末资产净值比例为 0.47%。

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	5,719,207.00	1.45
B	采矿业	5,303,387.00	1.35
C	制造业	189,721,465.35	48.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,042,559.44	1.28
E	建筑业	2,374,772.00	0.60
F	批发和零售业	1,490,686.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	12,826,635.00	3.25
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,212,250.54	2.08
J	金融业	88,254,765.12	22.39
K	房地产业	5,408,221.60	1.37
L	租赁和商务服务业	2,926,287.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	2,461,976.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	628,827.00	0.16
Q	卫生和社会工作	5,792,298.10	1.47
R	文化、体育和娱乐业	3,505,230.00	0.89
S	综合	—	—
	合计	339,668,567.15	86.17

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,936,704.00	0.49
C	制造业	20,182,726.38	5.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	941,138.00	0.24
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	2,037,120.00	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,010,313.63	0.51

J	金融业	2,452,425.00	0.62
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	159,814.20	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	17,733.80	0.00
S	综合	—	—
	合计	29,778,353.97	7.55

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601318	中国平安	209,630	18,233,617.40	4.63
2	600519	贵州茅台	8,500	16,983,000.00	4.31
3	000858	五 粮 液	43,352	12,652,281.20	3.21
4	600036	招商银行	271,200	11,919,240.00	3.02
5	000333	美的集团	101,465	9,988,214.60	2.53
6	600276	恒瑞医药	82,164	9,157,999.44	2.32
7	601166	兴业银行	374,358	7,812,851.46	1.98
8	601012	隆基股份	70,801	6,527,852.20	1.66
9	000568	泸州老窖	25,234	5,706,921.44	1.45
10	000001	平安银行	288,100	5,571,854.00	1.41
11	600031	三一重工	155,838	5,451,213.24	1.38

12	002415	海康威视	110,500	5,360,355.00	1.36
13	002714	牧原股份	66,400	5,119,440.00	1.30
14	300124	汇川技术	49,565	4,624,414.50	1.17
15	601601	中国太保	119,566	4,591,334.40	1.16
16	600309	万华化学	48,400	4,406,336.00	1.12
17	601899	紫金矿业	474,100	4,404,389.00	1.12
18	000725	京东方 A	731,700	4,390,200.00	1.11
19	002142	宁波银行	123,700	4,371,558.00	1.11
20	600837	海通证券	323,300	4,157,638.00	1.05
21	000661	长春高新	8,600	3,860,626.00	0.98
22	002001	新 和 成	113,300	3,815,944.00	0.97
23	600570	恒生电子	35,329	3,706,012.10	0.94
24	002008	大族激光	84,600	3,616,650.00	0.92
25	600690	海尔智家	120,800	3,528,568.00	0.90
26	300413	芒果超媒	48,348	3,505,230.00	0.89
27	300347	泰格医药	20,600	3,329,166.00	0.84
28	002179	中航光电	41,913	3,281,368.77	0.83
29	601100	恒立液压	29,013	3,278,469.00	0.83
30	600900	长江电力	170,734	3,271,263.44	0.83
31	002475	立讯精密	56,909	3,193,733.08	0.81
32	600926	杭州银行	211,900	3,161,548.00	0.80
33	000651	格力电器	50,966	3,156,834.04	0.80
34	601628	中国人寿	82,100	3,151,819.00	0.80
35	000338	潍柴动力	194,400	3,069,576.00	0.78
36	601336	新华保险	51,200	2,968,064.00	0.75
37	002555	三七互娱	94,100	2,938,743.00	0.75
38	600009	上海机场	38,500	2,912,910.00	0.74
39	603369	今世缘	50,600	2,903,428.00	0.74

40	002508	老板电器	70,700	2,883,146.00	0.73
41	000768	中航西飞	78,400	2,875,712.00	0.73
42	000895	双汇发展	57,800	2,713,132.00	0.69
43	603899	晨光文具	30,100	2,665,656.00	0.68
44	600809	山西汾酒	7,100	2,664,559.00	0.68
45	601877	正泰电器	67,500	2,643,300.00	0.67
46	000596	古井贡酒	9,701	2,638,672.00	0.67
47	300059	东方财富	84,300	2,613,300.00	0.66
48	300015	爱尔眼科	32,890	2,463,132.10	0.62
49	600887	伊利股份	55,335	2,455,213.95	0.62
50	002601	龙蟠佰利	79,300	2,440,061.00	0.62
51	002414	高德红外	57,600	2,404,800.00	0.61
52	601888	中国中免	8,400	2,372,580.00	0.60
53	600030	中信证券	79,100	2,325,540.00	0.59
54	600177	雅戈尔	318,000	2,286,420.00	0.58
55	600161	天坛生物	54,200	2,260,140.00	0.57
56	000708	中信特钢	101,600	2,213,864.00	0.56
57	002916	深南电路	20,400	2,204,424.00	0.56
58	600004	白云机场	155,600	2,198,628.00	0.56
59	601021	春秋航空	39,400	2,183,942.00	0.55
60	600390	五矿资本	312,600	2,181,948.00	0.55
61	002773	康弘药业	45,200	2,176,380.00	0.55
62	002120	韵达股份	133,100	2,089,670.00	0.53
63	603288	海天味业	9,810	1,967,297.40	0.50
64	601838	成都银行	181,000	1,931,270.00	0.49
65	002352	顺丰控股	20,500	1,808,715.00	0.46
66	000002	万 科 A	59,300	1,701,910.00	0.43
67	300014	亿纬锂能	19,900	1,621,850.00	0.41

68	603833	欧派家居	12,000	1,614,000.00	0.41
69	603799	华友钴业	17,200	1,363,960.00	0.35
70	002594	比亚迪	6,800	1,321,240.00	0.34
71	000656	金科股份	185,500	1,315,195.00	0.33
72	002493	荣盛石化	47,500	1,311,475.00	0.33
73	600999	招商证券	54,260	1,266,428.40	0.32
74	603259	药明康德	9,400	1,266,368.00	0.32
75	600893	航发动力	21,200	1,258,220.00	0.32
76	600703	三安光电	45,800	1,237,058.00	0.31
77	300676	华大基因	9,300	1,195,608.00	0.30
78	600000	浦发银行	123,200	1,192,576.00	0.30
79	000063	中兴通讯	34,600	1,164,290.00	0.30
80	601186	中国铁建	141,200	1,115,480.00	0.28
81	600109	国金证券	68,000	1,106,360.00	0.28
82	002050	三花智控	44,000	1,084,600.00	0.28
83	600104	上汽集团	42,300	1,033,812.00	0.26
84	600585	海螺水泥	19,900	1,027,238.00	0.26
85	600196	复星医药	17,300	934,027.00	0.24
86	300408	三环集团	24,300	905,175.00	0.23
87	002241	歌尔股份	24,092	899,113.44	0.23
88	600299	安迪苏	75,100	864,401.00	0.22
89	000066	中国长城	45,200	858,348.00	0.22
90	601211	国泰君安	47,700	836,181.00	0.21
91	600998	九州通	45,700	829,912.00	0.21
92	601881	中国银河	66,100	826,911.00	0.21
93	300142	沃森生物	21,100	813,616.00	0.21
94	601009	南京银行	98,913	799,217.04	0.20
95	600741	华域汽车	26,200	755,084.00	0.19

96	000786	北新建材	18,400	736,920.00	0.19
97	000157	中联重科	73,500	727,650.00	0.18
98	601818	光大银行	175,200	699,048.00	0.18
99	000961	中南建设	78,500	693,155.00	0.18
100	000538	云南白药	6,100	692,960.00	0.18
101	601169	北京银行	142,600	690,184.00	0.18
102	600015	华夏银行	110,000	687,500.00	0.17
103	600919	江苏银行	125,280	684,028.80	0.17
104	601377	兴业证券	76,800	666,624.00	0.17
105	300033	同花顺	5,300	657,094.00	0.17
106	601231	环旭电子	33,900	655,626.00	0.17
107	600655	豫园股份	72,600	645,414.00	0.16
108	601229	上海银行	81,800	641,312.00	0.16
109	600886	国投电力	73,700	636,768.00	0.16
110	600436	片仔癀	2,359	631,056.09	0.16
111	002607	中公教育	17,900	628,827.00	0.16
112	601939	建设银行	98,500	618,580.00	0.16
113	600606	绿地控股	103,200	601,656.00	0.15
114	601766	中国中车	113,000	600,030.00	0.15
115	300498	温氏股份	32,900	599,767.00	0.15
116	002841	视源股份	5,200	598,156.00	0.15
117	300433	蓝思科技	19,400	593,834.00	0.15
118	601066	中信建投	14,000	588,000.00	0.15
119	002157	正邦科技	33,500	570,840.00	0.14
120	601138	工业富联	41,300	565,397.00	0.14
121	688036	传音控股	3,714	565,047.96	0.14
122	300136	信维通信	15,700	563,316.00	0.14
123	002027	分众传媒	56,100	553,707.00	0.14

124	601998	中信银行	107,900	551,369.00	0.14
125	600029	南方航空	86,400	514,944.00	0.13
126	601390	中国中铁	97,500	513,825.00	0.13
127	002624	完美世界	17,400	513,300.00	0.13
128	600115	东方航空	108,900	509,652.00	0.13
129	601088	中国神华	27,400	493,474.00	0.13
130	003816	中国广核	174,400	491,808.00	0.12
131	600383	金地集团	35,900	484,650.00	0.12
132	000977	浪潮信息	17,900	481,152.00	0.12
133	600271	航天信息	36,100	454,860.00	0.12
134	601117	中国化学	77,100	452,577.00	0.11
135	600025	华能水电	101,000	450,460.00	0.11
136	601872	招商轮船	72,200	407,930.00	0.10
137	600845	宝信软件	5,500	379,390.00	0.10
138	600050	中国联通	81,700	364,382.00	0.09
139	601633	长城汽车	9,000	340,290.00	0.09
140	600346	恒力石化	11,900	332,843.00	0.08
141	600438	通威股份	8,200	315,208.00	0.08
142	600019	宝钢股份	52,900	314,755.00	0.08
143	000938	紫光股份	15,300	312,885.00	0.08
144	000069	华侨城 A	44,000	311,960.00	0.08
145	601225	陕西煤业	33,200	310,088.00	0.08
146	600406	国电南瑞	10,600	281,642.00	0.07
147	601800	中国交建	38,700	280,962.00	0.07
148	600061	国投资本	19,700	272,451.00	0.07
149	601216	君正集团	53,400	264,330.00	0.07
150	601688	华泰证券	13,900	250,339.00	0.06
151	601658	邮储银行	46,599	222,743.22	0.06

152	300529	健帆生物	3,200	217,024.00	0.06
153	002304	洋河股份	900	212,391.00	0.05
154	601919	中远海控	16,400	200,244.00	0.05
155	000776	广发证券	12,100	196,988.00	0.05
156	002460	赣锋锂业	1,800	182,160.00	0.05
157	000783	长江证券	17,026	143,018.40	0.04
158	002271	东方雨虹	3,450	133,860.00	0.03
159	600048	保利地产	8,200	129,724.00	0.03
160	601077	渝农商行	28,000	126,000.00	0.03
161	600600	青岛啤酒	1,200	119,280.00	0.03
162	300122	智飞生物	800	118,328.00	0.03
163	002202	金风科技	7,600	108,300.00	0.03
164	001979	招商蛇口	8,100	107,649.00	0.03
165	002736	国信证券	7,800	106,392.00	0.03
166	600760	中航沈飞	1,300	101,634.00	0.03
167	600011	华能国际	21,500	96,320.00	0.02
168	601985	中国核电	19,500	95,940.00	0.02
169	600584	长电科技	2,200	93,654.00	0.02
170	603195	公牛集团	400	82,116.00	0.02
171	600958	东方证券	6,500	75,595.00	0.02
172	603993	洛阳钼业	10,900	68,125.00	0.02
173	600340	华夏幸福	4,820	62,322.60	0.02
174	603986	兆易创新	300	59,250.00	0.02
175	002236	大华股份	2,900	57,681.00	0.01
176	000166	申万宏源	10,900	57,552.00	0.01
177	000625	长安汽车	2,100	45,948.00	0.01
178	000100	TCL 科技	6,300	44,604.00	0.01
179	601198	东兴证券	3,300	43,956.00	0.01

180	300628	亿联网络	600	43,872.00	0.01
181	601577	长沙银行	4,400	41,888.00	0.01
182	002049	紫光国微	300	40,143.00	0.01
183	600872	中炬高新	500	33,325.00	0.01
184	002958	青农商行	6,300	32,067.00	0.01
185	601238	广汽集团	2,300	30,567.00	0.01
186	002821	凯莱英	100	29,914.00	0.01
187	002812	恩捷股份	200	28,356.00	0.01
188	600489	中金黄金	3,100	27,311.00	0.01
189	603501	韦尔股份	100	23,110.00	0.01
190	002007	华兰生物	500	21,120.00	0.01
191	000703	恒逸石化	1,600	20,480.00	0.01
192	002230	科大讯飞	500	20,435.00	0.01
193	600745	闻泰科技	200	19,800.00	0.01
194	601555	东吴证券	1,800	17,748.00	0.00
195	601607	上海医药	800	15,360.00	0.00
196	601108	财通证券	1,200	15,180.00	0.00
197	601668	中国建筑	2,400	11,928.00	0.00
198	601788	光大证券	600	11,112.00	0.00
199	601162	天风证券	1,400	8,540.00	0.00
200	002410	广联达	106	8,346.44	0.00
201	600660	福耀玻璃	100	4,805.00	0.00
202	300003	乐普医疗	100	2,718.00	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	000813	德展健康	481,000	2,130,830.00	0.54

2	603317	天味食品	25,200	2,072,448.00	0.53
3	600258	首旅酒店	96,000	2,037,120.00	0.52
4	300496	中科创达	16,800	1,965,600.00	0.50
5	000878	云南铜业	135,400	1,959,238.00	0.50
6	600426	华鲁恒升	52,270	1,949,671.00	0.49
7	600338	西藏珠峰	184,800	1,936,704.00	0.49
8	600699	均胜电子	75,300	1,909,608.00	0.48
9	601799	星宇股份	9,400	1,884,700.00	0.48
10	600563	法拉电子	17,300	1,860,615.00	0.47
11	002670	国盛金控	115,100	1,582,625.00	0.40
12	601966	玲珑轮胎	33,600	1,181,712.00	0.30
13	002051	中工国际	121,000	857,890.00	0.22
14	000301	东方盛虹	61,132	579,531.36	0.15
15	002353	杰瑞股份	11,700	409,500.00	0.10
16	688608	恒玄科技	796	263,476.00	0.07
17	002507	涪陵榨菜	5,700	241,110.00	0.06
18	688686	奥普特	1,282	218,619.46	0.06
19	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.05
20	300999	金龙鱼	2,029	179,140.41	0.05
21	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.05
22	600038	中直股份	2,600	163,046.00	0.04
23	688155	先惠技术	2,403	161,625.78	0.04
24	688338	赛科希德	2,854	155,799.86	0.04
25	688519	南亚新材	5,079	154,960.29	0.04
26	688386	泛亚微透	3,217	152,517.97	0.04
27	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.04
28	603806	福斯特	1,600	136,640.00	0.03
29	688580	伟思医疗	1,086	106,873.26	0.03

30	688219	会通股份	7,336	100,503.20	0.03
31	603338	浙江鼎力	900	91,071.00	0.02
32	688617	惠泰医疗	1,204	89,649.84	0.02
33	600970	中材国际	12,100	83,248.00	0.02
34	688528	秦川物联	4,950	80,883.00	0.02
35	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.02
36	688309	恒誉环保	1,810	58,879.30	0.01
37	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
38	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01
39	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
40	300894	火星人	628	23,217.16	0.01
41	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
42	300861	美畅股份	424	21,666.40	0.01
43	300919	中伟股份	342	21,036.42	0.01
44	300910	瑞丰新材	415	19,866.05	0.01
45	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
46	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
47	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
48	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
49	300860	锋尚文化	140	17,733.80	0.00
50	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
51	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
52	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
53	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
54	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
55	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
56	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
57	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00

58	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
59	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
60	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
61	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
62	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
63	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
64	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
65	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
66	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
67	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
68	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
69	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
70	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
71	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
72	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
73	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
74	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	601318	中国平安	36,326,033.86	25.60
2	600519	贵州茅台	34,251,604.00	24.14
3	000858	五 粮 液	32,887,279.56	23.17
4	600036	招商银行	31,212,248.13	21.99
5	601012	隆基股份	29,737,604.31	20.96
6	000001	平安银行	26,655,378.81	18.78

7	600276	恒瑞医药	26,190,779.25	18.46
8	002241	歌尔股份	24,519,082.94	17.28
9	601888	中国中免	24,079,193.72	16.97
10	601601	中国太保	23,607,129.68	16.64
11	600183	生益科技	21,678,508.06	15.28
12	600031	三一重工	21,646,668.71	15.25
13	603288	海天味业	20,984,856.61	14.79
14	600887	伊利股份	20,698,506.90	14.59
15	600030	中信证券	20,626,701.95	14.53
16	300014	亿纬锂能	20,043,332.36	14.12
17	000333	美的集团	19,961,729.89	14.07
18	600919	江苏银行	19,944,242.20	14.05
19	000568	泸州老窖	19,163,764.68	13.50
20	601166	兴业银行	18,889,576.80	13.31
21	603899	晨光文具	18,775,083.38	13.23
22	601628	中国人寿	18,726,493.66	13.20
23	603799	华友钴业	18,288,717.60	12.89
24	601211	国泰君安	18,023,606.00	12.70
25	000895	双汇发展	17,905,944.70	12.62
26	002050	三花智控	17,836,993.04	12.57
27	002415	海康威视	17,749,661.07	12.51
28	600000	浦发银行	17,725,925.00	12.49
29	002916	深南电路	17,474,778.16	12.31
30	300347	泰格医药	17,233,452.43	12.14
31	600926	杭州银行	17,173,939.30	12.10
32	002142	宁波银行	16,864,513.48	11.88
33	002271	东方雨虹	16,629,032.65	11.72
34	000651	格力电器	16,624,302.89	11.71

35	600406	国电南瑞	16,552,945.14	11.66
36	002508	老板电器	16,224,255.30	11.43
37	000661	长春高新	16,216,685.00	11.43
38	300059	东方财富	16,003,575.09	11.28
39	002555	三七互娱	15,963,797.11	11.25
40	002475	立讯精密	15,832,309.39	11.16
41	601933	永辉超市	15,749,098.80	11.10
42	002714	牧原股份	15,659,741.29	11.03
43	300033	同花顺	15,559,001.95	10.96
44	601336	新华保险	15,473,765.57	10.90
45	300124	汇川技术	15,412,982.13	10.86
46	002179	中航光电	15,267,339.31	10.76
47	601688	华泰证券	15,260,261.00	10.75
48	600837	海通证券	14,859,043.86	10.47
49	600038	中直股份	14,852,863.28	10.47
50	600585	海螺水泥	14,709,680.98	10.37
51	600177	雅戈尔	14,668,165.40	10.34
52	002594	比亚迪	14,544,278.16	10.25
53	601066	中信建投	14,367,360.77	10.12
54	601117	中国化学	14,222,356.00	10.02
55	300015	爱尔眼科	14,092,984.84	9.93
56	000157	中联重科	13,809,163.69	9.73
57	000338	潍柴动力	13,785,776.51	9.71
58	600015	华夏银行	13,781,535.00	9.71
59	601229	上海银行	13,659,997.63	9.63
60	000786	北新建材	13,552,921.87	9.55
61	600438	通威股份	13,401,333.50	9.44
62	002410	广联达	13,295,823.88	9.37

63	600109	国金证券	13,286,889.91	9.36
64	600390	五矿资本	13,269,576.00	9.35
65	002352	顺丰控股	13,115,650.07	9.24
66	002493	荣盛石化	13,106,136.25	9.24
67	600741	华域汽车	13,018,515.88	9.17
68	000002	万 科 A	12,766,348.40	9.00
69	601088	中国神华	12,718,532.67	8.96
70	601939	建设银行	12,695,112.00	8.95
71	600900	长江电力	12,636,422.76	8.90
72	002008	大族激光	12,560,420.72	8.85
73	002007	华兰生物	12,520,520.92	8.82
74	300413	芒果超媒	12,508,069.45	8.81
75	002601	龙蟠佰利	12,399,540.00	8.74
76	300003	乐普医疗	12,168,101.37	8.57
77	002460	赣锋锂业	12,129,084.60	8.55
78	600346	恒力石化	12,117,824.17	8.54
79	601009	南京银行	12,087,998.76	8.52
80	601877	正泰电器	12,087,137.00	8.52
81	601100	恒立液压	11,992,719.91	8.45
82	600028	中国石化	11,830,336.00	8.34
83	600745	闻泰科技	11,815,370.00	8.33
84	300136	信维通信	11,690,200.00	8.24
85	601169	北京银行	11,601,476.00	8.18
86	000725	京东方 A	11,595,764.00	8.17
87	000625	长安汽车	11,583,069.18	8.16
88	300408	三环集团	11,577,757.17	8.16
89	601838	成都银行	11,464,097.66	8.08
90	600011	华能国际	11,402,892.31	8.04

91	601328	交通银行	11,381,719.00	8.02
92	600016	民生银行	11,372,134.00	8.01
93	601231	环旭电子	11,311,421.00	7.97
94	600115	东方航空	11,217,420.52	7.90
95	000538	云南白药	11,067,276.51	7.80
96	600588	用友网络	11,061,295.00	7.79
97	002311	海大集团	11,014,127.35	7.76
98	600004	白云机场	10,964,178.00	7.73
99	002001	新 和 成	10,941,088.00	7.71
100	600570	恒生电子	10,918,974.57	7.69
101	600690	海尔智家	10,874,802.48	7.66
102	601138	工业富联	10,800,395.00	7.61
103	603501	韦尔股份	10,702,472.00	7.54
104	600998	九州通	10,668,165.32	7.52
105	002027	分众传媒	10,532,014.00	7.42
106	600009	上海机场	10,448,651.50	7.36
107	600340	华夏幸福	10,114,030.91	7.13
108	600760	中航沈飞	10,076,895.00	7.10
109	000656	金科股份	9,969,103.55	7.02
110	300601	康泰生物	9,963,074.02	7.02
111	000938	紫光股份	9,726,435.86	6.85
112	601236	红塔证券	9,613,159.11	6.77
113	601899	紫金矿业	9,599,396.00	6.76
114	601111	中国国航	9,496,863.00	6.69
115	601577	长沙银行	9,454,786.44	6.66
116	603658	安图生物	9,402,856.03	6.63
117	603259	药明康德	9,394,393.20	6.62
118	300142	沃森生物	9,337,915.00	6.58

119	600660	福耀玻璃	9,276,988.51	6.54
120	600309	万华化学	9,248,361.00	6.52
121	603986	兆易创新	9,035,600.14	6.37
122	002230	科大讯飞	9,022,258.45	6.36
123	002624	完美世界	8,927,962.98	6.29
124	002157	正邦科技	8,866,108.00	6.25
125	600809	山西汾酒	8,830,116.30	6.22
126	300498	温氏股份	8,809,060.74	6.21
127	300628	亿联网络	8,803,594.32	6.20
128	603833	欧派家居	8,698,626.63	6.13
129	600029	南方航空	8,680,006.00	6.12
130	603338	浙江鼎力	8,506,547.00	5.99
131	600547	山东黄金	8,424,756.20	5.94
132	002032	苏泊尔	8,421,430.26	5.93
133	601225	陕西煤业	8,420,941.72	5.93
134	000961	中南建设	8,404,912.87	5.92
135	601857	中国石油	8,375,280.00	5.90
136	600989	宝丰能源	8,288,445.00	5.84
137	600050	中国联通	8,176,962.00	5.76
138	600637	东方明珠	8,130,082.74	5.73
139	002304	洋河股份	8,053,954.50	5.68
140	600176	中国巨石	8,015,846.40	5.65
141	600436	片仔癀	7,708,262.23	5.43
142	600372	中航电子	7,543,807.45	5.32
143	601390	中国中铁	7,260,230.00	5.12
144	000708	中信特钢	7,234,577.00	5.10
145	600703	三安光电	7,042,495.00	4.96
146	002146	荣盛发展	7,007,525.78	4.94

147	601077	渝农商行	6,996,577.00	4.93
148	000703	恒逸石化	6,939,303.99	4.89
149	000728	国元证券	6,932,031.91	4.88
150	601818	光大银行	6,708,468.00	4.73
151	600048	保利地产	6,599,337.00	4.65
152	300122	智飞生物	6,516,270.00	4.59
153	600655	豫园股份	6,487,663.98	4.57
154	601198	东兴证券	6,257,469.00	4.41
155	000513	丽珠集团	6,247,426.58	4.40
156	600196	复星医药	6,101,877.76	4.30
157	000876	新希望	5,960,884.00	4.20
158	601916	浙商银行	5,919,719.00	4.17
159	002371	北方华创	5,911,905.52	4.17
160	000063	中兴通讯	5,767,352.81	4.06
161	600352	浙江龙盛	5,727,790.00	4.04
162	002938	鹏鼎控股	5,718,083.84	4.03
163	600089	特变电工	5,682,851.00	4.00
164	601021	春秋航空	5,668,026.00	3.99
165	601377	兴业证券	5,641,029.40	3.98
166	000977	浪潮信息	5,543,072.48	3.91
167	601901	方正证券	5,484,836.00	3.86
168	600258	首旅酒店	5,388,927.00	3.80
169	601633	长城汽车	5,383,202.00	3.79
170	600299	安迪苏	5,381,282.00	3.79
171	002841	视源股份	5,378,302.98	3.79
172	600674	川投能源	5,353,285.65	3.77
173	002463	沪电股份	5,329,753.00	3.76
174	601881	中国银河	5,303,411.71	3.74

175	000776	广发证券	5,299,625.00	3.73
176	601555	东吴证券	5,245,854.00	3.70
177	300012	华测检测	5,217,428.00	3.68
178	600271	航天信息	5,177,164.00	3.65
179	603369	今世缘	5,149,728.00	3.63
180	600886	国投电力	5,125,944.00	3.61
181	600928	西安银行	5,050,568.20	3.56
182	600606	绿地控股	5,013,762.00	3.53
183	300433	蓝思科技	4,986,789.92	3.51
184	601766	中国中车	4,968,620.00	3.50
185	600705	中航资本	4,942,687.00	3.48
186	000069	华侨城 A	4,929,517.00	3.47
187	600958	东方证券	4,919,660.00	3.47
188	002242	九阳股份	4,913,998.72	3.46
189	600795	国电电力	4,896,073.00	3.45
190	600053	九鼎投资	4,842,898.52	3.41
191	600219	南山铝业	4,805,790.00	3.39
192	600489	中金黄金	4,803,707.00	3.39
193	600867	通化东宝	4,796,471.30	3.38
194	000690	宝新能源	4,782,711.00	3.37
195	603160	汇顶科技	4,756,040.81	3.35
196	600782	新钢股份	4,751,813.00	3.35
197	000596	古井贡酒	4,688,311.38	3.30
198	601658	邮储银行	4,624,404.00	3.26
199	600583	海油工程	4,565,464.00	3.22
200	600066	宇通客车	4,492,023.00	3.17
201	000878	云南铜业	4,448,035.00	3.13
202	600266	城建发展	4,429,607.00	3.12

203	600383	金地集团	4,396,335.73	3.10
204	000627	天茂集团	4,384,549.00	3.09
205	603317	天味食品	4,381,087.00	3.09
206	300144	宋城演艺	4,374,273.86	3.08
207	002120	韵达股份	4,372,518.00	3.08
208	002252	上海莱士	4,370,335.00	3.08
209	002044	美年健康	4,363,737.23	3.07
210	600019	宝钢股份	4,327,017.68	3.05
211	601966	玲珑轮胎	4,234,868.00	2.98
212	600104	上汽集团	4,120,997.97	2.90
213	000166	申万宏源	4,076,982.00	2.87
214	601799	星宇股份	4,042,495.96	2.85
215	002745	木林森	4,030,693.00	2.84
216	000783	长江证券	3,960,923.38	2.79
217	601006	大秦铁路	3,896,146.00	2.75
218	002773	康弘药业	3,892,144.04	2.74
219	600757	长江传媒	3,831,611.00	2.70
220	002945	华林证券	3,756,081.00	2.65
221	600522	中天科技	3,745,302.00	2.64
222	600999	招商证券	3,736,958.98	2.63
223	002736	国信证券	3,727,592.00	2.63
224	601998	中信银行	3,715,146.00	2.62
225	601997	贵阳银行	3,559,492.00	2.51
226	002673	西部证券	3,491,348.00	2.46
227	000425	徐工机械	3,487,479.00	2.46
228	600111	北方稀土	3,479,881.00	2.45
229	603515	欧普照明	3,474,675.87	2.45
230	002648	卫星石化	3,419,035.00	2.41

231	600893	航发动力	3,399,045.00	2.40
232	601689	拓普集团	3,388,709.00	2.39
233	002867	周大生	3,379,678.65	2.38
234	002511	中顺洁柔	3,368,500.71	2.37
235	600027	华电国际	3,346,574.65	2.36
236	002236	大华股份	3,336,221.81	2.35
237	600161	天坛生物	3,282,955.80	2.31
238	300482	万孚生物	3,205,259.00	2.26
239	002233	塔牌集团	3,196,095.23	2.25
240	002602	世纪华通	3,104,852.00	2.19
241	600170	上海建工	3,085,123.00	2.17
242	002434	万里扬	3,074,813.40	2.17
243	002414	高德红外	3,036,022.00	2.14
244	600195	中牧股份	3,023,157.00	2.13
245	601186	中国铁建	3,000,278.00	2.11
246	601200	上海环境	2,965,613.40	2.09
247	000598	兴蓉环境	2,958,825.00	2.08
248	600058	五矿发展	2,953,400.00	2.08
249	002821	凯莱英	2,943,185.00	2.07
250	600233	圆通速递	2,933,197.00	2.07
251	300595	欧普康视	2,917,441.00	2.06
252	601985	中国核电	2,910,814.00	2.05
253	600380	健康元	2,887,048.00	2.03
254	002429	兆驰股份	2,882,785.00	2.03
255	603882	金域医学	2,875,842.00	2.03

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	30,903,626.00	21.78
2	601012	隆基股份	30,154,148.72	21.25
3	000858	五 粮 液	26,171,538.76	18.44
4	600519	贵州茅台	25,752,120.78	18.15
5	002241	歌尔股份	24,467,601.88	17.24
6	600276	恒瑞医药	23,615,259.01	16.64
7	600887	伊利股份	23,336,812.61	16.44
8	601888	中国中免	22,778,887.92	16.05
9	600036	招商银行	22,558,864.62	15.90
10	600183	生益科技	22,307,803.28	15.72
11	000001	平安银行	21,948,517.74	15.47
12	603288	海天味业	21,398,527.80	15.08
13	600031	三一重工	21,381,395.37	15.07
14	300014	亿纬锂能	19,742,759.74	13.91
15	601601	中国太保	19,486,081.81	13.73
16	600000	浦发银行	19,402,835.90	13.67
17	600919	江苏银行	19,203,273.75	13.53
18	603799	华友钴业	19,123,689.34	13.48
19	601211	国泰君安	19,017,895.48	13.40
20	600030	中信证券	18,179,102.00	12.81
21	000895	双汇发展	18,157,870.16	12.80
22	002271	东方雨虹	17,978,970.42	12.67
23	000568	泸州老窖	17,108,943.68	12.06
24	600406	国电南瑞	17,080,657.93	12.04
25	002050	三花智控	16,997,591.15	11.98
26	600038	中直股份	16,930,957.32	11.93
27	603899	晨光文具	16,855,674.15	11.88

28	600585	海螺水泥	16,353,947.96	11.52
29	002415	海康威视	16,321,038.85	11.50
30	601628	中国人寿	16,244,873.34	11.45
31	300347	泰格医药	15,992,799.96	11.27
32	002555	三七互娱	15,771,374.49	11.11
33	601933	永辉超市	15,611,114.20	11.00
34	601166	兴业银行	15,486,013.20	10.91
35	600926	杭州银行	15,282,615.68	10.77
36	002594	比亚迪	15,221,905.00	10.73
37	002007	华兰生物	15,040,286.60	10.60
38	601066	中信建投	14,927,624.18	10.52
39	300059	东方财富	14,892,140.53	10.49
40	601328	交通银行	14,870,625.60	10.48
41	000651	格力电器	14,852,188.50	10.47
42	300033	同花顺	14,817,592.84	10.44
43	601688	华泰证券	14,715,091.00	10.37
44	000661	长春高新	14,637,978.00	10.31
45	002916	深南电路	14,547,677.75	10.25
46	600016	民生银行	14,432,146.73	10.17
47	002475	立讯精密	14,383,045.53	10.14
48	002508	老板电器	14,273,475.81	10.06
49	600438	通威股份	14,261,286.86	10.05
50	300124	汇川技术	14,035,267.84	9.89
51	000157	中联重科	14,001,238.39	9.87
52	000333	美的集团	13,920,728.18	9.81
53	002179	中航光电	13,852,680.96	9.76
54	002352	顺丰控股	13,726,534.00	9.67
55	601117	中国化学	13,637,393.00	9.61

56	601336	新华保险	13,590,535.60	9.58
57	002410	广联达	13,369,648.24	9.42
58	600741	华域汽车	13,180,904.87	9.29
59	002142	宁波银行	13,173,174.85	9.28
60	600015	华夏银行	13,168,990.72	9.28
61	600346	恒力石化	13,144,996.80	9.26
62	601169	北京银行	13,118,023.29	9.24
63	601229	上海银行	13,046,781.87	9.19
64	000786	北新建材	12,847,188.74	9.05
65	600028	中国石化	12,747,579.00	8.98
66	600177	雅戈尔	12,727,597.01	8.97
67	002460	赣锋锂业	12,541,709.00	8.84
68	601088	中国神华	12,256,784.00	8.64
69	002493	荣盛石化	12,202,635.39	8.60
70	601939	建设银行	12,099,126.00	8.53
71	600109	国金证券	12,076,310.68	8.51
72	300015	爱尔眼科	12,031,389.10	8.48
73	000625	长安汽车	12,012,273.81	8.46
74	600745	闻泰科技	11,823,075.46	8.33
75	300136	信维通信	11,788,073.04	8.31
76	601100	恒立液压	11,519,104.28	8.12
77	002311	海大集团	11,405,008.85	8.04
78	601009	南京银行	11,301,925.12	7.96
79	600390	五矿资本	11,278,184.15	7.95
80	300498	温氏股份	11,191,980.96	7.89
81	000002	万科A	11,183,526.19	7.88
82	300003	乐普医疗	11,120,801.00	7.84
83	600011	华能国际	11,081,324.23	7.81

84	002027	分众传媒	11,062,321.25	7.80
85	600588	用友网络	10,875,043.65	7.66
86	300408	三环集团	10,866,837.93	7.66
87	002601	龙蟠佰利	10,745,897.45	7.57
88	601231	环旭电子	10,685,265.90	7.53
89	601111	中国国航	10,668,328.91	7.52
90	000338	潍柴动力	10,624,673.80	7.49
91	600115	东方航空	10,595,718.00	7.47
92	000538	云南白药	10,570,949.02	7.45
93	002304	洋河股份	10,542,976.00	7.43
94	600340	华夏幸福	10,519,744.20	7.41
95	600690	海尔智家	10,275,138.06	7.24
96	600029	南方航空	10,249,633.00	7.22
97	300601	康泰生物	10,129,288.74	7.14
98	600436	片仔癀	10,112,186.19	7.13
99	601236	红塔证券	10,088,257.00	7.11
100	600760	中航沈飞	10,027,205.00	7.07
101	601138	工业富联	9,969,497.67	7.03
102	603501	韦尔股份	9,956,128.00	7.02
103	600837	海通证券	9,877,334.00	6.96
104	002714	牧原股份	9,860,749.70	6.95
105	600660	福耀玻璃	9,803,921.39	6.91
106	601838	成都银行	9,754,578.00	6.87
107	600998	九州通	9,709,295.00	6.84
108	601877	正泰电器	9,683,689.42	6.82
109	603658	安图生物	9,482,214.40	6.68
110	603259	药明康德	9,459,859.55	6.67
111	601577	长沙银行	9,368,623.71	6.60

112	600900	长江电力	9,331,696.50	6.58
113	000938	紫光股份	9,273,993.12	6.54
114	300413	芒果超媒	9,140,456.27	6.44
115	002008	大族激光	8,942,826.34	6.30
116	600809	山西汾酒	8,937,917.00	6.30
117	300628	亿联网络	8,876,192.50	6.25
118	002230	科大讯飞	8,806,769.80	6.21
119	000656	金科股份	8,642,062.98	6.09
120	600176	中国巨石	8,590,485.88	6.05
121	002624	完美世界	8,574,256.00	6.04
122	600004	白云机场	8,503,717.00	5.99
123	300433	蓝思科技	8,316,137.40	5.86
124	601857	中国石油	8,312,385.00	5.86
125	601225	陕西煤业	8,272,438.52	5.83
126	600547	山东黄金	8,249,831.89	5.81
127	603338	浙江鼎力	8,139,536.65	5.74
128	002157	正邦科技	8,088,098.47	5.70
129	300142	沃森生物	8,076,773.98	5.69
130	002032	苏泊尔	8,065,173.14	5.68
131	601899	紫金矿业	8,001,065.00	5.64
132	000776	广发证券	7,990,378.00	5.63
133	603986	兆易创新	7,976,256.43	5.62
134	000725	京东方A	7,896,771.00	5.56
135	600050	中国联通	7,841,466.00	5.53
136	600637	东方明珠	7,769,954.15	5.48
137	600009	上海机场	7,748,400.10	5.46
138	002001	新和成	7,646,350.30	5.39
139	600989	宝丰能源	7,605,717.00	5.36

140	600570	恒生电子	7,569,800.61	5.33
141	000961	中南建设	7,467,562.00	5.26
142	603833	欧派家居	7,363,074.38	5.19
143	600372	中航电子	7,272,385.60	5.12
144	000728	国元证券	7,210,226.41	5.08
145	601377	兴业证券	7,165,207.40	5.05
146	600795	国电电力	7,000,224.00	4.93
147	000703	恒逸石化	6,942,169.10	4.89
148	002146	荣盛发展	6,907,562.69	4.87
149	601077	渝农商行	6,832,355.00	4.81
150	601390	中国中铁	6,805,313.94	4.80
151	300122	智飞生物	6,762,516.00	4.77
152	000069	华侨城 A	6,669,065.68	4.70
153	002371	北方华创	6,535,765.30	4.61
154	600048	保利地产	6,518,764.00	4.59
155	601766	中国中车	6,443,730.00	4.54
156	600522	中天科技	6,352,741.00	4.48
157	000627	天茂集团	6,259,098.84	4.41
158	601198	东兴证券	6,241,766.17	4.40
159	600703	三安光电	6,193,838.00	4.36
160	000166	申万宏源	6,192,911.00	4.36
161	000513	丽珠集团	6,123,349.28	4.31
162	600089	特变电工	6,024,643.67	4.25
163	601916	浙商银行	5,913,064.00	4.17
164	601818	光大银行	5,912,464.00	4.17
165	000708	中信特钢	5,887,642.25	4.15
166	000876	新希望	5,846,626.00	4.12
167	600196	复星医药	5,844,864.16	4.12

168	600655	豫园股份	5,787,987.85	4.08
169	601633	长城汽车	5,661,259.59	3.99
170	601901	方正证券	5,625,896.00	3.96
171	600104	上汽集团	5,593,613.01	3.94
172	600309	万华化学	5,573,162.00	3.93
173	002236	大华股份	5,564,236.80	3.92
174	600352	浙江龙盛	5,510,113.00	3.88
175	600674	川投能源	5,483,244.75	3.86
176	600705	中航资本	5,431,918.00	3.83
177	002938	鹏鼎控股	5,396,020.24	3.80
178	600867	通化东宝	5,344,261.42	3.77
179	601555	东吴证券	5,205,798.00	3.67
180	300012	华测检测	5,184,825.33	3.65
181	000977	浪潮信息	5,081,448.61	3.58
182	600928	西安银行	5,009,893.36	3.53
183	002841	视源股份	4,862,188.10	3.43
184	600958	东方证券	4,849,445.71	3.42
185	002463	沪电股份	4,830,600.00	3.40
186	300144	宋城演艺	4,827,023.19	3.40
187	000690	宝新能源	4,785,397.00	3.37
188	600053	九鼎投资	4,766,543.00	3.36
189	600066	宇通客车	4,735,326.73	3.34
190	600219	南山铝业	4,710,010.00	3.32
191	600489	中金黄金	4,653,411.05	3.28
192	603160	汇顶科技	4,652,829.00	3.28
193	601658	邮储银行	4,635,688.00	3.27
194	601668	中国建筑	4,633,820.00	3.27
195	000063	中兴通讯	4,608,186.00	3.25

196	600782	新钢股份	4,597,759.00	3.24
197	601881	中国银河	4,476,455.64	3.15
198	002242	九阳股份	4,474,157.05	3.15
199	600266	城建发展	4,404,916.00	3.10
200	600583	海油工程	4,366,999.00	3.08
201	600271	航天信息	4,350,649.25	3.07
202	600886	国投电力	4,343,527.00	3.06
203	002252	上海莱士	4,327,407.00	3.05
204	002736	国信证券	4,236,422.00	2.99
205	002945	华林证券	4,182,685.00	2.95
206	600606	绿地控股	4,167,653.48	2.94
207	002044	美年健康	4,152,330.60	2.93
208	002607	中公教育	4,131,048.00	2.91
209	002745	木林森	3,981,170.00	2.81
210	600299	安迪苏	3,948,693.68	2.78
211	600019	宝钢股份	3,931,126.00	2.77
212	300017	网宿科技	3,918,573.00	2.76
213	600383	金地集团	3,854,649.86	2.72
214	000783	长江证券	3,844,817.00	2.71
215	601006	大秦铁路	3,799,524.00	2.68
216	600757	长江传媒	3,787,491.00	2.67
217	600111	北方稀土	3,721,465.90	2.62
218	002153	石基信息	3,676,313.00	2.59
219	601021	春秋航空	3,595,213.79	2.53
220	601997	贵阳银行	3,506,428.00	2.47
221	603019	中科曙光	3,489,793.76	2.46
222	002673	西部证券	3,447,168.00	2.43
223	603515	欧普照明	3,422,984.00	2.41

224	000425	徐工机械	3,408,504.00	2.40
225	600258	首旅酒店	3,398,291.00	2.39
226	002867	周大生	3,397,893.39	2.39
227	600027	华电国际	3,378,178.00	2.38
228	601689	拓普集团	3,313,761.00	2.34
229	002648	卫星石化	3,280,771.00	2.31
230	002511	中顺洁柔	3,224,621.00	2.27
231	002602	世纪华通	3,219,122.80	2.27
232	002233	塔牌集团	3,189,183.00	2.25
233	601998	中信银行	3,136,073.00	2.21
234	600058	五矿发展	3,072,573.00	2.17
235	600170	上海建工	3,044,541.00	2.15
236	601966	玲珑轮胎	3,042,710.00	2.14
237	300482	万孚生物	2,992,345.66	2.11
238	601200	上海环境	2,972,180.00	2.09
239	000598	兴蓉环境	2,943,281.00	2.07
240	002821	凯莱英	2,893,400.00	2.04
241	002434	万里扬	2,893,277.82	2.04
242	600233	圆通速递	2,878,253.09	2.03

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	2,695,600,385.92
卖出股票收入（成交）总额	2,563,167,558.92

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	17,884,650.00	4.54
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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）	728,000.00	0.18
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	18,612,650.00	4.72

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	019640	20 国债 10	113,000	11,285,310.00	2.86
2	019627	20 国债 01	66,000	6,599,340.00	1.67
3	113044	大秦转债	7,280	728,000.00	0.18

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本期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、处罚的情形。

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	152,105.33
2	应收证券清算款	2,887,447.33
3	应收股利	-
4	应收利息	261,428.04
5	应收申购款	755,371.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,056,351.75
---	----	--------------

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

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	601318	中国平安	869,800.00	0.22	转融通证券出借
2	000333	美的集团	984,400.00	0.25	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计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 沪 深 300A	2,104	45,814.76	68,411,932.58	70.97%	27,982,312.75	29.03%
中 金 沪 深 300C	2,322	45,234.46	73,313,079.80	69.80%	31,721,332.30	30.20%
合计	4,426	45,510.32	141,725,012.38	70.36%	59,703,645.05	29.64%

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	中金沪深 300A	155,836.24	0.1617%
	中金沪深 300C	56,370.80	0.0537%
	合计	212,207.04	0.1054%

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	中金沪深 300A	0~10
	中金沪深 300C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	中金沪深 300A	0
	中金沪深 300C	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	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金 份额总额	10,001,300.00	—
本报告期期初基金份额总额	59,776,219.76	46,403,821.37
本报告期基金总申购份额	81,761,996.68	242,427,167.44
减:本报告期基金总赎回份额	45,143,971.11	183,796,576.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	96,394,245.33	105,034,412.10

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

本报告期内，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金自 2020 年 7 月 29 日至 2020 年 8 月 30 日 17:00 止以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，审议《关于中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更投资范围、投资限制和调整赎回费有关事项的议案》。会议议案于 2020 年 8 月 31 日获得通过，大会决议自同日起生效。自生效之日起，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务并实施调整后的赎回费率。

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

2020 年 5 月 28 日，本基金管理人发布公告，公司产生第三届董事会，由以下九名董事组成：楚钢先生、黄劲峰先生、徐翌成先生、孙菁女士、赵璧先生、汤琰女士、冒大卫先生（独立董事）、王元先生（独立董事）、江勇先生（独立董事）。原第二届董事会成员陈刚先生、李永先生、张春先生（独立董事）不再担任公司董事职务。

2020 年 6 月 30 日，本基金管理人发布公告，邱延冰先生自 2020 年 6 月 30 日起担任公司副总经理，分管公司投资研究业务；李永先生自同日起不再担任公司副总经理。

2020 年 12 月 24 日，本基金管理人发布公告，胡长生先生自 2020 年 12 月 23 日担任公司董事长；楚钢自同日起不再担任公司董事长。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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 40,000.00 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	
中金财富证券	2	1,627,119,826.46	31.04%	1,189,915.27	31.04%	—
兴业证券	2	1,213,584,384.07	23.15%	887,494.60	23.15%	—
中金公司	2	710,164,163.62	13.55%	519,345.86	13.55%	—
华创证券	2	618,990,760.72	11.81%	452,666.71	11.81%	—
招商证券	2	503,703,093.69	9.61%	368,357.82	9.61%	—
山西证券	1	215,077,273.68	4.10%	157,285.71	4.10%	—
长江证券	4	179,352,971.03	3.42%	131,160.77	3.42%	—
申港证券	1	94,796,058.61	1.81%	69,324.04	1.81%	—
天风证券	2	79,000,230.84	1.51%	57,774.13	1.51%	—

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、个股分析的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。

3、本基金本报告期新增招商证券 2 个交易单元、山西证券 1 个交易单元、长江证券 2 个交易单元、申港证券 1 个交易单元、天风证券 2 个交易单元。

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
中金财富证券	22,033,180.30	39.98%	377,800,000.00	40.21%	—	—
兴业证券	7,663,034.40	13.90%	136,100,000.00	14.49%	—	—
中金公司	188,015.80	0.34%	105,400,000.00	11.22%	—	—
华创证券	19,306,530.00	35.03%	131,700,000.00	14.02%	—	—
招商证券	5,843,613.45	10.60%	135,300,000.00	14.40%	—	—
山西证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	77,553.02	0.14%	42,200,000.00	4.49%	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	11,000,000.00	1.17%	—	—

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旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
2	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
3	中金基金管理有限公司关于旗下 28 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日

4	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同、托管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 18 日
5	中金沪深 300 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（2020 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 21 日
6	关于 2020 年春节假期延长及休市的相关通知	中国证监会规定媒介	2020 年 1 月 31 日
7	中金基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 3 月 21 日
8	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日
9	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年年度报告及其摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 21 日
10	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
11	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 22 日
12	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	-
13	关于中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金恢复	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 24 日

	大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告		
14	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 4 月 28 日
15	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 5 月 28 日
16	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 11 日
17	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 18 日
18	中金基金管理有限公司副总经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 6 月 30 日
19	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 7 日
20	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 9 日
21	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 11 日
22	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 11 日
23	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 21 日

	告提示性公告		
24	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 21 日
25	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 28 日
26	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 29 日
27	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 30 日
28	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 7 月 31 日
29	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 2 日
30	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 2 号)及摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 8 日
31	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 13 日

32	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 29 日
33	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年中期报告及摘要	中国证监会规定媒介	2020 年 8 月 29 日
34	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
35	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及托管协议提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
36	中金基金管理有限公司中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及托管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
37	中金基金管理有限公司关于中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 1 日
38	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 3 日
39	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要(更新)(2020/09/03)	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 3 日
40	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 10 日

	内承销证券的公告		
41	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 19 日
42	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 19 日
43	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 9 月 30 日
44	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 10 日
45	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 20 日
46	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 28 日
47	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 28 日
48	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 29 日
49	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 4 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 30 日
50	中金沪深 300 指数增强型发	中国证监会规定媒介	2020 年 10 月 30 日

	起式证券投资基金产品资料概要(更新)(2020 年第 4 号)		
51	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 11 月 28 日
52	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 18 日
53	中金基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 24 日
54	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 26 日
55	中金基金管理有限公司中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及托管协议	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 26 日
56	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 5 号)	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 30 日
57	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 30 日
58	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金沪深 300 指数指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金沪深 300 指数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

2021 年 3 月 31 日