

中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2021 年 03 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3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。

本报告中财务资料经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年5月9日（基金合同生效日）起至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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	78
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	78
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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	78
§9 基金份额持有人信息.....	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	80
§10 开放式基金份额变动.....	80
§11 重大事件揭示.....	81
11.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
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.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8 其他重大事件.....	83
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
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.....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
§13 备查文件目录.....	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	87
13.3 查阅方式.....	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证500增强	
基金主代码	006440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月09日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	106,996,101.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
下属各类别基金的交易代码	006440	006441
报告期末下属各类别基金的份额总额	62,276,486.95份	44,719,614.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证500指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成分股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险

	高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久
	联系电话	010-57760122
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	010-60836588
传真	010-59100298	010-60834004
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	100010	100125
法定代表人	蒋月勤	张佑君

注：基金管理人于2021年2月27日发布《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，黄凌先生自2021年2月26日起担任基金管理人董事长，并于2021年3月1日完成黄凌先生担任基金管理人法定代表人的工商变更登记。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒

	中心B座17、19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	本期2020年05月09日（基金合同生效日）- 2020年12月31日	
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
本期已实现收益	24,485,599.35	21,641,919.03
本期利润	23,566,183.83	23,989,622.01
加权平均基金份额本期利润	0.3121	0.3330
本期加权平均净值利润率	25.79%	28.37%
本期基金份额净值增长率	30.53%	30.28%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	
期末可供分配利润	19,014,858.81	13,540,509.81
期末可供分配基金份额利润	0.3053	0.3028
期末基金资产净值	81,291,345.76	58,260,124.12
期末基金份额净值	1.3053	1.3028
3.1.3 累计期末指标	2020年末	
基金份额累计净值增长率	30.53%	30.28%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

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

中信建投中证500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.24%	1.16%	2.70%	1.10%	0.54%	0.06%
过去六个月	19.02%	1.47%	8.20%	1.38%	10.82%	0.09%
自基金合同生效起至今	30.53%	1.33%	14.86%	1.29%	15.67%	0.04%

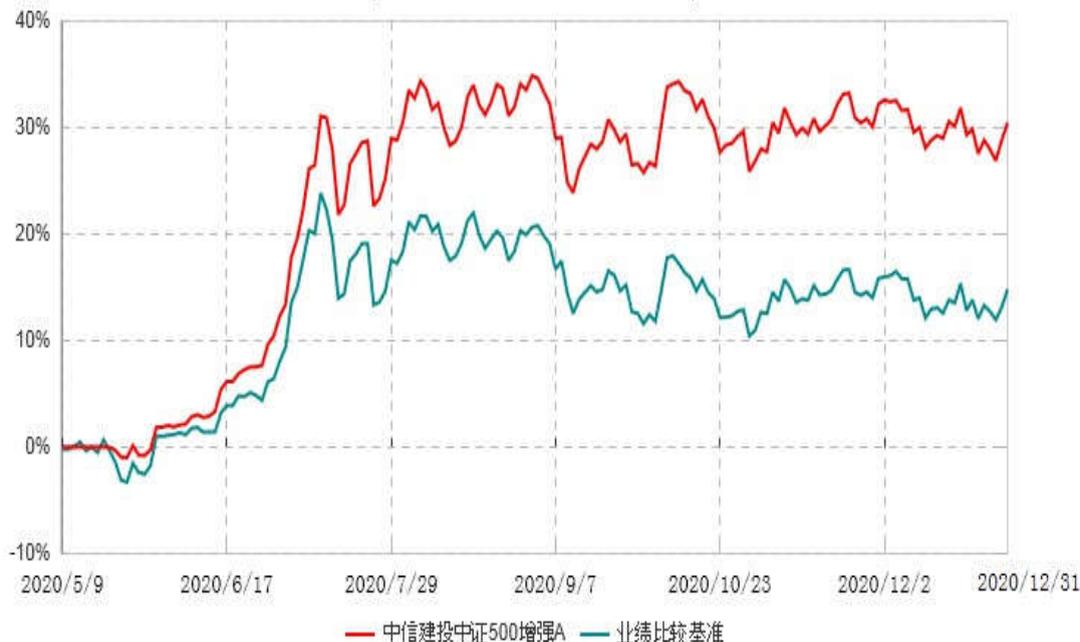
中信建投中证500增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.17%	1.16%	2.70%	1.10%	0.47%	0.06%
过去六个月	18.85%	1.47%	8.20%	1.38%	10.65%	0.09%
自基金合同生效起至今	30.28%	1.33%	14.86%	1.29%	15.42%	0.04%

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

中信建投中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月09日-2020年12月31日)



中信建投中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

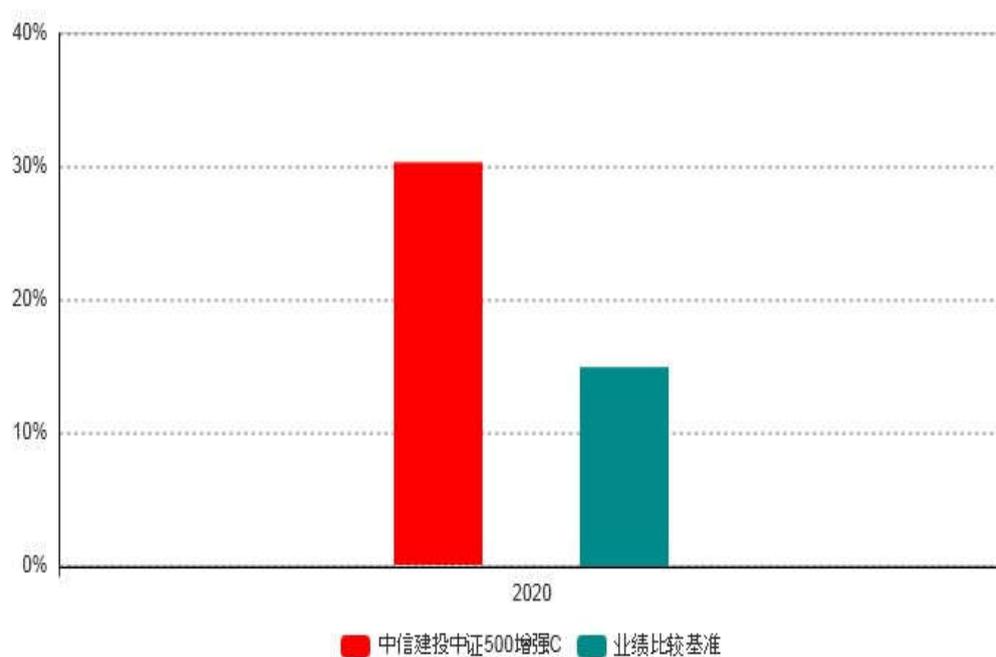
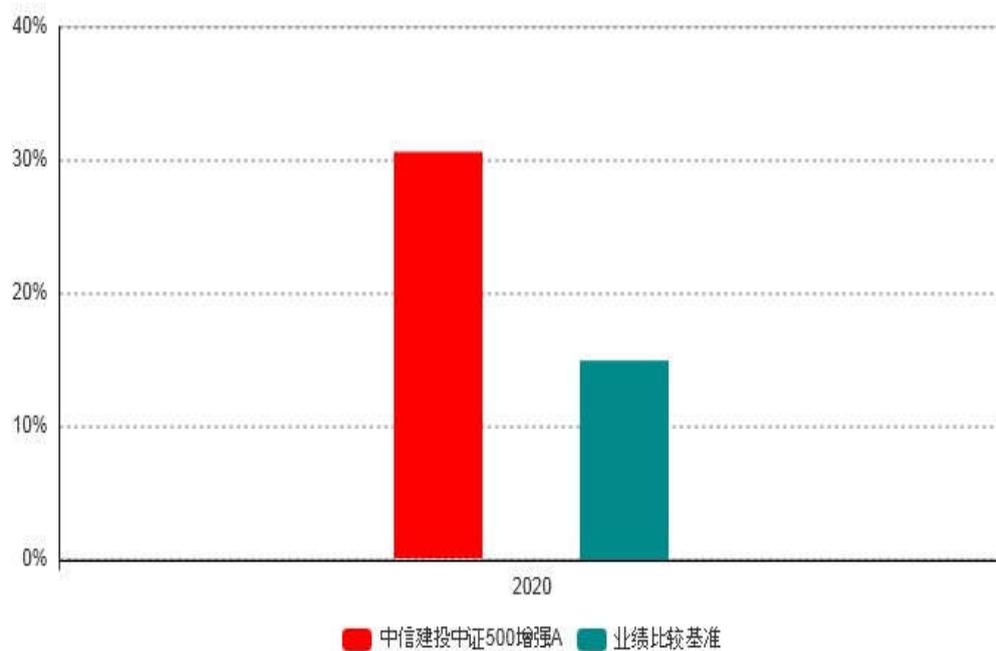
(2020年05月09日-2020年12月31日)



注：1、本基金基金合同生效于 2020 年 5 月 9 日，截至报告期末本基金基金合同生效未
满一年。

2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月为建仓期，建仓
期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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



注：基金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

本基金自成立以来未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京注册成立，注册资本3亿元，主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。中信建投基金全资子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

中信建投基金积极回归公募基金业务本源，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，公司主动投资管理能力大幅提升，在2020年二季度银河证券评价报告中，中信建投基金近一年基金管理人股票投资主动管理能力排名5/118，近三年基金管理人股票投资主动管理能力排名第14/91。

同时中信建投基金加强客户体系建设、积极拓展渠道，加大了与国有大行、股份制银行及证券公司的合作力度。公司各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为资产管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

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		
王鹏	本基金的 基金经理	2020-05-09	-	5年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIB C World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、金建

					睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司投资部指数与量化投资部负责人，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，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。

4.2 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，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，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，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

回首2020年，A股可谓一波三折，指数上涨的背景下是结构的持续分化。年初至三月底，为疫情冲击阶段，受疫情影响，全国按下暂停键，4月至7月中为疫情恢复期，全面复工，伴随着货币信用双宽松推动市场展开反弹，中国经济数据向好，出口强劲。7月中至年底为后疫情时代，宏观杠杆提升与信贷刺激使国内需求强劲导致企业盈利攀升，国内出口订单饱满，企业盈利攀升，创业板注册制等资本市场制度的改革吸引了居民通过基金入市，基金发行量剧增，推动了指数上涨也引发了消费与科技的集体抱团。

2020年末，我们团队系统性的迭代更新了量化模型，在模型中大比例加入了人工智能AI算法，通过算法来自适应市场各种风格的变化，以保障模型更有效地运转。同时，为了应对潜在的机构抱团现象的长期存在，团队正在积极开发轮动模型，预判行业/风格的趋势性，并超配相关的股票。力争在超额收益的基础外，博取额外的择时收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证500增强A基金份额净值为1.3053元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.53%，同期业绩比较基准收益率为14.86%；截至报告期末中信建投中证500增强C基金份额净值为1.3028元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.28%，同期业绩比较基准收益率为14.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021年，国内经济已从疫情中迅速恢复，现今宏观杠杆的提升与信贷的强刺激使得国内需求强劲，国外生产还在逐步恢复中，国内出口份额仍将进一步提升，预计企业盈利情况良好。海外经济目前仍遭受新冠病毒影响，预计2021年上半年疫苗大规模接种，全球疫情将逐步得到控制。欧美经济在刺激政策的支持下，经济恢复弹性较大。政策方面，预计明年拜登上台后的首要目标在疫情防控和财政刺激。中美博弈整体趋于缓和，预计明年上半年是中美博弈真空期，下半年拜登的对华政策框架更明朗，贸易上会重新评估中美关税，科技上仍会保持压制的态势，但金融和地缘方面冲突的概率很低。海外流动性预计整体宽松，国内财政政策将由宽松转向常规化，但国内市场流动性仍然充裕。

综上，我们对经济和企业盈利的中期前景保持乐观，同时上半年的外围政策性风险较小，A股大幅下行风险不大。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括投资部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中信建投中证500指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，中信建投基金管理有限公司在中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投中证500指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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	普华永道中天审字(2021)第21621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	中信建投中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	（一）我们审计的内容 我们审计了中信建投中证500指数增强型证券投资基金（以下简称“中信建投中证500增强基金”）的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债

	<p>表, 2020年5月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了中信建投中证500增强基金2020年12月31日的财务状况以及2020年5月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师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。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于中信建投中证500增强基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>中信建投中证500增强基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投中证500增强基金2020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。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已</p>

	<p>经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中信建投中证500增强基金的基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投中证500增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投中证500增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投中证500增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一)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</p>

	<p>未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)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。</p> <p>(四)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，就可能对中信建投中证500增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中信建投中证500增强基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛竞	郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2021-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	20,735,866.60
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	131,755,029.87
其中：股票投资		131,755,029.87
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,691.40
应收股利		-
应收申购款		322,538.42
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		152,816,126.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		12,960,891.98
应付管理人报酬		94,531.75
应付托管费		12,604.24
应付销售服务费		16,442.22
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	180,186.22
负债合计		13,264,656.41
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	106,996,101.26
未分配利润	7.4.7.10	32,555,368.62
所有者权益合计		139,551,469.88
负债和所有者权益总计		152,816,126.29

注：1、报告截止日2020年12月31日，基金份额总额106,996,101.26份，其中A类基金份额净值1.3053元，基金份额62,276,486.95份；C类基金份额净值1.3028元，基金份额44,719,614.31份。

2、本财务报表的实际编制期间为2020年5月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年
----	-----	------------------------------

		12月31日
一、收入		57,074,237.88
1. 利息收入		273,548.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	226,293.03
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		47,255.52
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		54,835,264.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	53,543,951.09
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,291,312.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,428,287.46
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	537,137.83
减：二、费用		9,518,432.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	845,246.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	112,699.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	162,013.62
4. 交易费用	7.4.7.18	8,138,951.62
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	7.4.7.19	259,520.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,555,805.84

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,555,805.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）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）	272,396,616.24	-	272,396,616.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,555,805.84	47,555,805.84
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）	-165,400,514.98	-15,000,437.22	-180,400,952.20
其中：1. 基金申购款	128,319,270.95	35,096,718.25	163,415,989.20
2. 基金赎回款	-293,719,785.93	-50,097,155.47	-343,816,941.40
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）	106,996,101.26	32,555,368.62	139,551,469.88

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：

黄凌

谭淼

谭保民

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

中信建投中证500指数增强型证券投资基金(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〔2020〕第367号《关于准予中信建投同顺量化逆向策略股票型证券投资基金变更注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0003号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年5月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为272,396,616.24份基金份额,其中认购资金利息折合146,489.89份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,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,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额,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认购/申购费用的一类基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款等)、货币市场工具、股指期货、国债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相关规定)。本基金的投

投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年5月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年5月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2020年5月9日（基金合同生效日）至2020年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对

金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指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。

(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。

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或资产支持证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；或者(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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本

基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券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和债券，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、市盈率法、现金流量折现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)》(以下简称“指引”)，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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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〔2008〕1号《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《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《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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。

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

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
活期存款	13,751,582.22
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	6,984,284.38
合计	20,735,866.60

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	130,326,742.41	131,755,029.87	1,428,287.46
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	130,326,742.41	131,755,029.87	1,428,287.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

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
应收活期存款利息	1,827.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	863.92
应收结算备付金利息	-
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	-
其他	-
合计	2,691.40

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
----	--------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	186.22
预提费用	130,000.00
其他应付	50,000.00
合计	180,186.22

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 中信建投中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	本期2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	109,947,302.18	109,947,302.18
本期申购	59,052,073.96	59,052,073.96
本期赎回（以“-”号填列）	-106,722,889.19	-106,722,889.19
本期末	62,276,486.95	62,276,486.95

7.4.7.9.2 中信建投中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	本期2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	162,449,314.06	162,449,314.06
本期申购	69,267,196.99	69,267,196.99
本期赎回（以“-”号填列）	-186,996,896.74	-186,996,896.74
本期末	44,719,614.31	44,719,614.31

注：1、本基金自2020年4月20日至2020年4月30日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币272,250,126.35元，折合为272,250,126.35份基金份额（其中A类基金份额109,885,019.35份，C类基金份额162,365,107.00份）。根据《中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币146,489.89元，在本基金成立后，折合为146,489.89份基金份额（其中A类基金份额62,282.83份，C类基金份额84,207.06份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》及《中信建投中证500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于2020年5月9日(基金合同生效日)至2020年6月9日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务自2020年6月10日起开始办理，赎回业务自2020年6月10日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中信建投中证500增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	24,485,599.35	-919,415.52	23,566,183.83
本期基金份额交易产生的变动数	-4,247,163.32	-304,161.70	-4,551,325.02
其中：基金申购款	14,450,879.06	1,613,449.50	16,064,328.56
基金赎回款	-18,698,042.38	-1,917,611.20	-20,615,653.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,238,436.03	-1,223,577.22	19,014,858.81

7.4.7.10.2 中信建投中证500增强C

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	21,641,919.03	2,347,702.98	23,989,622.01
本期基金份额交易产生的变动数	-7,223,900.38	-3,225,211.82	-10,449,112.20
其中：基金申购款	19,162,290.22	-129,900.53	19,032,389.69
基金赎回款	-26,386,190.60	-3,095,311.29	-29,481,501.89
本期已分配利润	-	-	-

本期末	14,418,018.65	-877,508.84	13,540,509.81
-----	---------------	-------------	---------------

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	200,102.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	26,190.66
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	226,293.03

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,702,997,298.04
减：卖出股票成本总额	1,649,453,346.95
买卖股票差价收入	53,543,951.09

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
----	--

股票投资产生的股利收益	1,291,312.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,291,312.95

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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	1,428,287.46
——股票投资	1,428,287.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,428,287.46

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	537,137.83
合计	537,137.83

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	8,138,951.62
银行间市场交易费用	-
合计	8,138,951.62

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	80,000.00
账户维护费	400.00
指数使用费	129,120.88
合计	259,520.88

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东

江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
--------------	----------

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。

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 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信证券股份有限公司	3,477,285,909.99	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信证券股份有限公司	648,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年05月09日（基金合同生效日）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
中信证券股份有限公司	6,113,993.88	100.00%	-	-

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、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	845,246.41
其中：支付销售机构的客户维护费	412,755.79

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.75% / 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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	112,699.51

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10% / 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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信证券 股份有限 公司	0.00	150,726.76	150,726.76
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	3,708.30	3,708.30
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	358.06	358.06
合计	0.00	154,793.12	154,793.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类的基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司-证券户	6,984,284.38	26,190.66

注：本基金证券户的存款由基金托管人中信证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年05月09日（基金合同生效日）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：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	688063	派能科技	网下配售	1,117	62,552.00
中信建投证券股份有限公司	688608	恒玄科技	网下配售	447	72,445.29
中信证券股份有限公司	003018	金富科技	网下配售	1,027	9,171.11

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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。

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
688579	山大地纬	2020-07-08	2021-01-18	科创板打新限售	8.12	14.38	9,617	78,090.04	138,292.46	-
300880	迦南智能	2020-08-25	2021-03-01	创业板打新限售	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
688608	恒玄科技	2020-12-07	2021-06-16	科创板打新限售	162.07	272.00	447	72,445.29	121,584.00	-
688788	科思科技	2020-10-13	2021-04-22	科创板打新限售	106.04	109.59	870	92,254.80	95,343.30	-
688560	明冠新材	2020-12-16	2021-06-24	科创板打新限售	15.87	22.86	3,136	49,768.32	71,688.96	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-

				售						
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	创业板打新限售	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	创业板打新限售	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	创业板打新限售	33.61	38.70	343	11,528.23	13,274.10	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	创业板打新限售	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	创业板打新限售	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	创业板打新限售	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	创业板打新限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
3008	海晨	2020	2021	创业	30.7	41.3	246	7,55	10,1	-

73	股份	-08-14	-03-02	板打 新限售	2	2		7.12	64.72	
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	创业 板打 新限售	44.47	74.52	135	6,003.45	10,060.20	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	创业 板打 新限售	29.57	40.67	246	7,274.22	10,004.82	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	创业 板打 新限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	创业 板打 新限售	30.26	47.87	202	6,112.52	9,669.74	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	创业 板打 新限售	20.08	37.33	254	5,100.32	9,481.82	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	创业 板打 新限售	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	创业 板打 新限售	4.97	8.94	1,028	5,109.16	9,190.32	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	创业 板打 新限售	71.71	90.85	95	6,812.45	8,630.75	-

				售						
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	创业板打新限售	24.35	33.06	247	6,014.45	8,165.82	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	创业板打新限售	27.97	30.12	244	6,824.68	7,349.28	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	创业板打新限售	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 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	股	停	停	期末	复	复牌	数量	期末成本	期末估值总	备
---	---	---	---	----	---	----	----	------	-------	---

票 代 码	票 名 称	牌 日 期	牌 原 因	估 值 单 价	牌 日 期	开 盘 单 价	(股)	总 额	额	注
300 182	捷 成 股 份	2020 -12- 30	重 大 事 项	3.23	2021 -01- 07	3.40	118,000	402,108.00	381,140.00	-

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽控合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、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。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽控合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

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和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。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。

7.4.13.2 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人的托管账户，开立在中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于2020年12月31日，本基金无债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

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

于2020年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的

10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2020年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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	20,735,866.60	-	-	-	20,735,866.60
交易性 金融资产	-	-	-	131,755,029.87	131,755,029.87
应收利息	-	-	-	2,691.40	2,691.40
应收申 购款	-	-	-	322,538.42	322,538.42
资产总 计	20,735,866.60	-	-	132,080,259.69	152,816,126.29
负债					
应付赎 回款	-	-	-	12,960,891.98	12,960,891.98
应付管 理人报 酬	-	-	-	94,531.75	94,531.75
应付托 管费	-	-	-	12,604.24	12,604.24
应付销 售服务 费	-	-	-	16,442.22	16,442.22
其他负 债	-	-	-	180,186.22	180,186.22
负债总 计	-	-	-	13,264,656.41	13,264,656.41
利率敏 感度缺 口	20,735,866.60	-	-	118,815,603.28	139,551,469.88

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

于2020年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为指数增强型基金，以中证500指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	131,755,029.87	94.41
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	131,755,029.87	94.41

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

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) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 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130,539,520.08元，属于第二层次的余额为1,215,509.79元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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。

§ 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	131,755,029.87	86.22
	其中：股票	131,755,029.87	86.22
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	20,735,866.60	13.57
8	其他各项资产	325,229.82	0.21
9	合计	152,816,126.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	520,184.00	0.37
B	采矿业	5,504,448.00	3.94
C	制造业	70,955,624.00	50.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,898,114.00	2.08
E	建筑业	2,862,124.00	2.05
F	批发和零售业	4,451,707.00	3.19

G	交通运输、仓储和邮政业	3,067,711.00	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,323,960.00	5.25
J	金融业	7,644,295.00	5.48
K	房地产业	2,337,455.00	1.67
L	租赁和商务服务业	1,201,860.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	402,005.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	774,459.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,715,272.00	1.23
R	文化、体育和娱乐业	2,975,783.00	2.13
S	综合	-	-
	合计	114,635,001.00	82.15

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	284,799.00	0.20
B	采矿业	471,939.00	0.34
C	制造业	13,651,299.78	9.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	206,403.00	0.15
E	建筑业	110,943.00	0.08
F	批发和零售业	504,365.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	130,620.72	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	707,917.42	0.51

J	金融业	292,296.00	0.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	401,928.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	10,060.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	138,940.75	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	115,929.00	0.08
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	92,588.00	0.07
	合计	17,120,028.87	12.27

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600409	三友化工	125,200	1,283,300.00	0.92
2	601168	西部矿业	96,500	1,194,670.00	0.86
3	600765	中航重机	46,600	1,165,000.00	0.83
4	603806	福斯特	13,600	1,161,440.00	0.83
5	601997	贵阳银行	145,100	1,153,545.00	0.83
6	603882	金域医学	9,000	1,153,080.00	0.83
7	600739	辽宁成大	47,300	1,150,336.00	0.82

8	600460	士兰微	45,300	1,132,500.00	0.81
9	600392	盛和资源	125,500	1,115,695.00	0.80
10	601128	常熟银行	143,600	1,059,768.00	0.76
11	601689	拓普集团	26,900	1,033,767.00	0.74
12	603317	天味食品	12,400	1,019,776.00	0.73
13	601598	中国外运	229,000	1,007,600.00	0.72
14	601233	桐昆股份	48,200	992,438.00	0.71
15	601068	中铝国际	275,200	979,712.00	0.70
16	603816	顾家家居	13,800	973,038.00	0.70
17	603638	艾迪精密	13,500	930,690.00	0.67
18	600699	均胜电子	35,500	900,280.00	0.65
19	601966	玲珑轮胎	25,400	893,318.00	0.64
20	603866	桃李面包	14,900	880,590.00	0.63
21	601717	郑煤机	80,400	878,772.00	0.63
22	600039	四川路桥	194,800	878,548.00	0.63
23	603883	老百姓	13,900	873,337.00	0.63
24	601098	中南传媒	90,400	861,512.00	0.62
25	300207	欣旺达	27,200	835,312.00	0.60
26	002901	大博医疗	11,000	811,030.00	0.58
27	300595	欧普康视	9,900	811,008.00	0.58
28	002745	木林森	55,500	809,745.00	0.58
29	600959	江苏有线	244,300	808,633.00	0.58
30	000887	中鼎股份	69,000	807,990.00	0.58
31	600704	物产中大	184,000	804,080.00	0.58
32	603712	七一二	19,300	803,845.00	0.58
33	000807	云铝股份	106,500	801,945.00	0.57
34	600507	方大特钢	115,500	801,570.00	0.57
35	002128	露天煤业	72,900	797,526.00	0.57
36	600901	江苏租赁	143,100	788,481.00	0.57
37	300630	普利制药	17,800	745,642.00	0.53
38	000581	威孚高科	31,800	737,442.00	0.53

39	600373	中文传媒	72,400	730,516.00	0.52
40	001914	招商积余	33,500	721,255.00	0.52
41	603486	科沃斯	8,100	716,769.00	0.51
42	300168	万达信息	33,000	715,770.00	0.51
43	000960	锡业股份	63,800	714,560.00	0.51
44	002926	华西证券	57,100	712,608.00	0.51
45	300146	汤臣倍健	29,200	705,180.00	0.51
46	002382	蓝帆医疗	32,800	691,752.00	0.50
47	000600	建投能源	122,000	684,420.00	0.49
48	600079	人福医药	20,100	680,988.00	0.49
49	300463	迈克生物	14,200	661,720.00	0.47
50	300699	光威复材	7,400	658,970.00	0.47
51	000690	宝新能源	90,200	658,460.00	0.47
52	600038	中直股份	10,400	652,184.00	0.47
53	600737	中粮糖业	67,100	649,528.00	0.47
54	000883	湖北能源	167,200	648,736.00	0.46
55	600885	宏发股份	11,700	634,374.00	0.45
56	600339	中油工程	204,400	629,552.00	0.45
57	600053	九鼎投资	32,100	627,555.00	0.45
58	002124	天邦股份	42,600	621,960.00	0.45
59	600160	巨化股份	76,200	617,982.00	0.44
60	601000	唐山港	247,900	614,792.00	0.44
61	600970	中材国际	89,300	614,384.00	0.44
62	600779	水井坊	7,400	614,348.00	0.44
63	300058	蓝色光标	101,400	608,400.00	0.44
64	300324	旋极信息	143,800	608,274.00	0.44
65	300001	特锐德	20,400	598,944.00	0.43
66	300482	万孚生物	6,700	597,707.00	0.43
67	000932	华菱钢铁	124,900	597,022.00	0.43
68	603338	浙江鼎力	5,900	597,021.00	0.43
69	002818	富森美	42,000	593,460.00	0.43

70	600563	法拉电子	5,500	591,525.00	0.42
71	600835	上海机电	30,100	585,746.00	0.42
72	000686	东北证券	59,400	583,308.00	0.42
73	000156	华数传媒	68,100	582,936.00	0.42
74	600580	卧龙电驱	37,100	578,760.00	0.41
75	688321	微芯生物	15,600	577,356.00	0.41
76	002138	顺络电子	23,500	576,220.00	0.41
77	002064	华峰氨纶	57,000	575,130.00	0.41
78	002705	新宝股份	13,600	574,600.00	0.41
79	002568	百润股份	5,400	563,166.00	0.40
80	601865	福莱特	14,100	562,590.00	0.40
81	300244	迪安诊断	16,400	562,192.00	0.40
82	603260	合盛硅业	16,800	561,792.00	0.40
83	000738	航发控制	24,400	559,492.00	0.40
84	000988	华工科技	23,900	554,241.00	0.40
85	000869	张裕 A	12,700	553,720.00	0.40
86	000937	冀中能源	132,900	552,864.00	0.40
87	603228	景旺电子	18,300	551,745.00	0.40
88	000060	中金岭南	114,300	550,926.00	0.39
89	600188	兖州煤业	54,500	548,815.00	0.39
90	600497	驰宏锌锗	114,000	547,200.00	0.39
91	000729	燕京啤酒	64,000	545,280.00	0.39
92	002557	洽洽食品	10,100	543,885.00	0.39
93	600667	太极实业	57,100	539,595.00	0.39
94	600879	航天电子	72,100	539,308.00	0.39
95	300271	华宇软件	22,500	537,075.00	0.38
96	600928	西安银行	95,200	529,312.00	0.38
97	002156	通富微电	20,800	524,992.00	0.38
98	688088	虹软科技	7,500	524,400.00	0.38
99	603056	德邦股份	41,200	522,828.00	0.37
100	002299	圣农发展	19,600	520,184.00	0.37

101	002028	思源电气	25,600	513,536.00	0.37
102	603198	迎驾贡酒	14,700	513,030.00	0.37
103	002595	豪迈科技	17,300	512,945.00	0.37
104	002092	中泰化学	82,300	506,145.00	0.36
105	601615	明阳智能	26,600	504,868.00	0.36
106	600782	新钢股份	109,500	502,605.00	0.36
107	600141	兴发集团	45,500	501,865.00	0.36
108	601799	星宇股份	2,500	501,250.00	0.36
109	000488	晨鸣纸业	77,500	497,550.00	0.36
110	300357	我武生物	6,400	490,880.00	0.35
111	002368	太极股份	18,800	490,868.00	0.35
112	600862	中航高科	16,300	490,630.00	0.35
113	300212	易华录	16,000	490,400.00	0.35
114	600827	百联股份	33,500	489,100.00	0.35
115	600201	生物股份	23,200	484,648.00	0.35
116	600515	海航基础	71,400	481,950.00	0.35
117	002212	天融信	22,900	481,129.00	0.34
118	600643	爱建集团	63,800	479,776.00	0.34
119	002423	中粮资本	49,100	475,288.00	0.34
120	600348	阳泉煤业	84,200	472,362.00	0.34
121	603885	吉祥航空	41,100	467,307.00	0.33
122	002244	滨江集团	100,700	462,213.00	0.33
123	000636	风华高科	13,700	461,690.00	0.33
124	300316	晶盛机电	15,300	460,224.00	0.33
125	002807	江阴银行	106,800	457,104.00	0.33
126	000830	鲁西化工	35,700	456,246.00	0.33
127	002294	信立泰	16,100	456,113.00	0.33
128	600575	淮河能源	196,200	455,184.00	0.33
129	603786	科博达	6,700	453,054.00	0.32
130	000717	韶钢松山	104,400	445,788.00	0.32
131	002839	张家港行	72,300	441,030.00	0.32

132	002701	奥瑞金	87,900	434,226.00	0.31
133	688002	睿创微纳	3,900	432,900.00	0.31
134	002544	杰赛科技	25,700	431,246.00	0.31
135	000513	丽珠集团	10,600	429,300.00	0.31
136	300257	开山股份	31,300	427,245.00	0.31
137	300474	景嘉微	6,100	426,451.00	0.31
138	002957	科瑞技术	20,600	421,270.00	0.30
139	601928	凤凰传媒	66,300	419,679.00	0.30
140	002444	巨星科技	13,300	413,763.00	0.30
141	002690	美亚光电	9,200	407,376.00	0.29
142	600597	光明乳业	25,000	406,500.00	0.29
143	600216	浙江医药	29,800	405,280.00	0.29
144	600556	天下秀	31,900	403,535.00	0.29
145	603568	伟明环保	21,300	403,209.00	0.29
146	600645	中源协和	20,500	402,005.00	0.29
147	600733	北汽蓝谷	46,000	398,820.00	0.29
148	002191	劲嘉股份	42,900	395,967.00	0.28
149	600064	南京高科	38,500	395,395.00	0.28
150	600372	中航电子	20,100	394,965.00	0.28
151	603650	彤程新材	12,700	393,700.00	0.28
152	600500	中化国际	74,700	393,669.00	0.28
153	603355	莱克电气	13,000	392,990.00	0.28
154	002434	万里扬	44,000	392,480.00	0.28
155	000501	鄂武商 A	33,600	391,440.00	0.28
156	600126	杭钢股份	73,800	390,402.00	0.28
157	600633	浙数文化	47,900	389,906.00	0.28
158	601003	柳钢股份	75,100	389,769.00	0.28
159	601611	中国核建	53,500	389,480.00	0.28
160	002648	卫星石化	14,900	389,188.00	0.28
161	000739	普洛药业	16,700	388,776.00	0.28
162	000543	皖能电力	92,800	387,904.00	0.28

163	603345	安井食品	2,000	385,740.00	0.28
164	002250	联化科技	16,000	383,840.00	0.28
165	002416	爱施德	51,400	383,444.00	0.27
166	300182	捷成股份	118,000	381,140.00	0.27
167	002155	湖南黄金	44,300	376,993.00	0.27
168	002266	浙富控股	82,500	371,250.00	0.27
169	002408	齐翔腾达	44,200	369,512.00	0.26
170	002221	东华能源	35,500	359,970.00	0.26
171	300010	豆神教育	36,800	359,168.00	0.26
172	300418	昆仑万维	17,900	357,105.00	0.26
173	300115	长盈精密	14,400	354,960.00	0.25
174	002152	广电运通	33,000	352,440.00	0.25
175	002075	沙钢股份	31,400	344,458.00	0.25
176	002507	涪陵榨菜	8,100	342,630.00	0.25
177	002019	亿帆医药	17,800	336,954.00	0.24
178	002500	山西证券	37,600	336,520.00	0.24
179	000021	深科技	17,700	336,477.00	0.24
180	000547	航天发展	12,200	335,500.00	0.24
181	002056	横店东磁	21,700	329,623.00	0.24
182	002268	卫士通	19,700	328,990.00	0.24
183	002013	中航机电	28,600	327,470.00	0.23
184	300166	东方国信	29,800	326,310.00	0.23
185	000559	万向钱潮	59,600	318,860.00	0.23
186	000039	中集集团	21,100	316,289.00	0.23
187	000685	中山公用	38,000	315,400.00	0.23
188	000301	东方盛虹	32,800	310,944.00	0.22
189	300072	三聚环保	54,300	308,424.00	0.22
190	002946	新乳业	16,900	297,609.00	0.21
191	300134	大富科技	28,700	296,471.00	0.21
192	002925	盈趣科技	4,600	295,918.00	0.21
193	002683	宏大爆破	8,200	294,790.00	0.21

194	002317	众生药业	26,600	293,132.00	0.21
195	002815	崇达技术	19,200	277,248.00	0.20
196	002373	千方科技	14,500	277,240.00	0.20
197	002867	周大生	10,400	277,160.00	0.20
198	000732	泰禾集团	84,600	276,642.00	0.20
199	000898	鞍钢股份	90,800	276,032.00	0.20
200	000959	首钢股份	72,000	275,760.00	0.20
201	000997	新大陆	18,000	275,040.00	0.20
202	000970	中科三环	29,100	274,995.00	0.20
203	600008	首创股份	71,800	203,194.00	0.15
204	600316	洪都航空	3,300	187,671.00	0.13
205	600535	天士力	8,100	119,799.00	0.09
206	600808	马钢股份	44,900	119,434.00	0.09
207	002603	以岭药业	4,400	112,200.00	0.08
208	002372	伟星新材	4,900	91,630.00	0.07
209	000983	山西焦煤	15,900	89,676.00	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000951	中国重汽	8,200	257,972.00	0.18
2	002878	元隆雅图	11,100	228,216.00	0.16
3	600809	山西汾酒	600	225,174.00	0.16
4	603886	元祖股份	12,600	214,704.00	0.15
5	300415	伊之密	15,500	207,545.00	0.15
6	688169	石头科技	200	207,200.00	0.15
7	002335	科华恒盛	9,000	201,060.00	0.14

8	002022	科华生物	12,900	198,918.00	0.14
9	603043	广州酒家	5,000	193,650.00	0.14
10	002258	利尔化学	9,200	192,280.00	0.14
11	000589	贵州轮胎	29,100	191,478.00	0.14
12	601225	陕西煤业	20,500	191,470.00	0.14
13	601636	旗滨集团	14,600	186,880.00	0.13
14	300737	科顺股份	8,600	184,556.00	0.13
15	002483	润邦股份	31,900	180,235.00	0.13
16	603877	太平鸟	6,000	180,000.00	0.13
17	603661	恒林股份	3,300	179,322.00	0.13
18	300690	双一科技	3,000	175,590.00	0.13
19	600888	新疆众和	29,000	175,160.00	0.13
20	002027	分众传媒	17,600	173,712.00	0.12
21	600887	伊利股份	3,900	173,043.00	0.12
22	603301	振德医疗	2,700	168,831.00	0.12
23	300119	瑞普生物	8,900	168,032.00	0.12
24	603600	永艺股份	12,600	167,328.00	0.12
25	603578	三星新材	7,500	166,425.00	0.12
26	600710	苏美达	29,100	162,960.00	0.12
27	600028	中国石化	40,100	161,603.00	0.12
28	603686	龙马环卫	10,000	160,800.00	0.12
29	603100	川仪股份	14,200	160,176.00	0.11
30	000568	泸州老窖	700	158,312.00	0.11
31	002298	中电兴发	16,800	156,744.00	0.11
32	002487	大金重工	17,200	156,348.00	0.11
33	600496	精工钢构	33,600	150,528.00	0.11
34	002139	拓邦股份	18,100	146,791.00	0.11
35	002367	康力电梯	14,900	146,467.00	0.10
36	600438	通威股份	3,800	146,072.00	0.10
37	002312	三泰控股	25,100	143,823.00	0.10
38	600075	新疆天业	25,100	141,815.00	0.10

39	600894	广日股份	17,300	139,784.00	0.10
40	601222	林洋能源	17,600	139,392.00	0.10
41	688579	山大地纬	9,617	138,292.46	0.10
42	300462	华铭智能	6,800	136,884.00	0.10
43	300639	凯普生物	3,600	135,288.00	0.10
44	300535	达威股份	9,600	134,880.00	0.10
45	300400	劲拓股份	10,600	133,030.00	0.10
46	002677	浙江美大	8,300	132,219.00	0.09
47	600810	神马股份	14,200	131,918.00	0.09
48	000026	飞亚达	11,500	131,445.00	0.09
49	002241	歌尔股份	3,500	130,620.00	0.09
50	000610	西安旅游	15,700	130,310.00	0.09
51	600293	三峡新材	46,300	130,103.00	0.09
52	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.09
53	601126	四方股份	18,600	129,456.00	0.09
54	603801	志邦家居	3,700	127,687.00	0.09
55	603208	江山欧派	1,200	126,300.00	0.09
56	300578	会畅通讯	3,100	124,186.00	0.09
57	600366	宁波韵升	19,100	121,858.00	0.09
58	603337	杰克股份	4,000	121,680.00	0.09
59	600783	鲁信创投	8,200	121,606.00	0.09
60	688608	恒玄科技	447	121,584.00	0.09
61	002772	众兴菌业	10,500	121,275.00	0.09
62	603871	嘉友国际	5,600	120,456.00	0.09
63	002228	合兴包装	28,300	119,143.00	0.09
64	688019	安集科技	400	119,120.00	0.09
65	002921	联诚精密	6,100	119,072.00	0.09
66	601088	中国神华	6,600	118,866.00	0.09
67	002614	奥佳华	8,800	118,360.00	0.08
68	600458	时代新材	13,900	118,289.00	0.08
69	600011	华能国际	26,200	117,376.00	0.08

70	603626	科森科技	10,100	116,251.00	0.08
71	002607	中公教育	3,300	115,929.00	0.08
72	002293	罗莱生活	9,300	115,785.00	0.08
73	300587	天铁股份	9,200	114,540.00	0.08
74	000612	焦作万方	16,300	114,426.00	0.08
75	300617	安靠智电	2,300	114,379.00	0.08
76	002641	永高股份	17,800	113,564.00	0.08
77	000576	甘化科工	10,700	113,420.00	0.08
78	601117	中国化学	18,900	110,943.00	0.08
79	603050	科林电气	8,300	110,224.00	0.08
80	300443	金雷股份	3,300	109,791.00	0.08
81	300363	博腾股份	3,000	109,560.00	0.08
82	300740	御家汇	5,900	106,790.00	0.08
83	002669	康达新材	6,400	105,408.00	0.08
84	000725	京东方 A	17,400	104,400.00	0.07
85	002154	报喜鸟	31,100	103,563.00	0.07
86	300394	天孚通信	1,900	101,327.00	0.07
87	300677	英科医疗	600	100,890.00	0.07
88	300888	稳健医疗	600	99,600.00	0.07
89	002668	奥马电器	24,400	96,624.00	0.07
90	688788	科思科技	870	95,343.30	0.07
91	002364	中恒电气	10,600	95,294.00	0.07
92	002067	景兴纸业	26,900	94,419.00	0.07
93	002179	中航光电	1,200	93,948.00	0.07
94	000532	华金资本	7,900	92,588.00	0.07
95	002939	长城证券	7,000	90,090.00	0.06
96	002318	久立特材	8,200	89,380.00	0.06
97	000544	中原环保	12,700	89,027.00	0.06
98	300259	新天科技	17,900	88,963.00	0.06
99	300679	电连技术	2,600	88,322.00	0.06
100	002534	杭锅股份	9,500	87,495.00	0.06

101	002430	杭氧股份	3,000	87,270.00	0.06
102	300539	横河模具	11,700	87,048.00	0.06
103	002157	正邦科技	5,100	86,904.00	0.06
104	300726	宏达电子	1,200	86,820.00	0.06
105	300077	国民技术	10,600	86,814.00	0.06
106	000921	海信家电	6,000	86,460.00	0.06
107	000592	平潭发展	31,200	86,424.00	0.06
108	000157	中联重科	8,700	86,130.00	0.06
109	002100	天康生物	8,000	84,720.00	0.06
110	002461	珠江啤酒	7,900	84,451.00	0.06
111	300074	华平股份	19,900	84,177.00	0.06
112	300660	江苏雷利	4,600	83,628.00	0.06
113	300547	川环科技	8,200	83,394.00	0.06
114	300380	安硕信息	4,200	83,244.00	0.06
115	002446	盛路通信	12,200	82,838.00	0.06
116	002832	比音勒芬	5,100	82,824.00	0.06
117	002272	川润股份	13,300	81,529.00	0.06
118	300611	美力科技	8,300	81,423.00	0.06
119	002114	罗平锌电	10,000	81,100.00	0.06
120	300824	北鼎股份	2,900	80,997.00	0.06
121	002362	汉王科技	3,300	80,652.00	0.06
122	300059	东方财富	2,600	80,600.00	0.06
123	002637	赞宇科技	6,400	80,448.00	0.06
124	300359	全通教育	13,200	80,256.00	0.06
125	300622	博士眼镜	5,700	79,857.00	0.06
126	002979	雷赛智能	1,800	79,812.00	0.06
127	300281	金明精机	13,000	79,430.00	0.06
128	300165	天瑞仪器	16,000	79,360.00	0.06
129	300666	江丰电子	1,600	79,216.00	0.06
130	002454	松芝股份	13,200	78,804.00	0.06
131	000799	酒鬼酒	500	78,250.00	0.06

132	000698	沈阳化工	16,600	78,186.00	0.06
133	002539	云图控股	10,500	77,595.00	0.06
134	002714	牧原股份	1,000	77,100.00	0.06
135	688560	明冠新材	3,136	71,688.96	0.05
136	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.03
137	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.02
138	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
139	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
140	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
141	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
142	300902	国安达	551	13,367.26	0.01
143	300871	回盛生物	343	13,274.10	0.01
144	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
145	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.01
146	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
147	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
148	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
149	300873	海晨股份	246	10,164.72	0.01
150	300887	谱尼测试	135	10,060.20	0.01
151	300909	汇创达	246	10,004.82	0.01
152	300893	松原股份	276	9,682.08	0.01
153	300910	瑞丰新材	202	9,669.74	0.01
154	300925	C法本	254	9,481.82	0.01
155	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.01
156	300918	南山智尚	1,028	9,190.32	0.01
157	300864	南大环境	95	8,630.75	0.01
158	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
159	300911	亿田智能	247	8,165.82	0.01
160	300889	爱克股份	244	7,349.28	0.01
161	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
162	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00

163	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603568	伟明环保	12,162,882.24	8.72
2	600216	浙江医药	11,817,714.88	8.47
3	603866	桃李面包	10,702,114.00	7.67
4	600845	宝信软件	10,678,371.96	7.65
5	601615	明阳智能	10,640,549.81	7.62
6	603444	吉比特	10,580,611.95	7.58
7	600195	中牧股份	9,914,500.28	7.10
8	300418	昆仑万维	9,884,549.56	7.08
9	600770	综艺股份	9,509,512.06	6.81
10	300002	神州泰岳	9,500,339.91	6.81
11	002709	天赐材料	9,157,047.55	6.56
12	002414	高德红外	9,054,620.30	6.49
13	000807	云铝股份	9,015,947.00	6.46
14	002416	爱施德	8,804,952.46	6.31
15	603233	大参林	8,697,980.06	6.23
16	002223	鱼跃医疗	8,493,730.00	6.09
17	300115	长盈精密	8,487,243.00	6.08
18	600874	创业环保	8,396,885.00	6.02
19	002030	达安基因	8,307,222.09	5.95
20	000600	建投能源	8,115,115.00	5.82
21	002382	蓝帆医疗	8,106,506.99	5.81
22	601865	福莱特	8,053,593.37	5.77
23	002028	思源电气	8,035,924.13	5.76
24	600064	南京高科	7,974,418.00	5.71

25	000090	天健集团	7,960,727.68	5.70
26	601966	玲珑轮胎	7,884,358.93	5.65
27	600143	金发科技	7,847,433.20	5.62
28	002603	以岭药业	7,698,552.00	5.52
29	600704	物产中大	7,539,907.06	5.40
30	603806	福斯特	7,526,904.00	5.39
31	601689	拓普集团	7,518,628.14	5.39
32	601717	郑煤机	7,453,287.00	5.34
33	600298	安琪酵母	7,418,244.39	5.32
34	300618	寒锐钴业	7,310,153.86	5.24
35	300316	晶盛机电	7,203,499.00	5.16
36	603882	金域医学	7,128,388.03	5.11
37	002434	万里扬	7,102,684.59	5.09
38	000932	华菱钢铁	6,978,979.53	5.00
39	601799	星宇股份	6,939,787.48	4.97
40	002124	天邦股份	6,875,489.00	4.93
41	600521	华海药业	6,837,173.02	4.90
42	600549	厦门钨业	6,739,103.56	4.83
43	000975	银泰黄金	6,729,224.40	4.82
44	600201	生物股份	6,579,644.00	4.71
45	002507	涪陵榨菜	6,552,840.95	4.70
46	300496	中科创达	6,506,252.00	4.66
47	600060	海信视像	6,412,460.26	4.60
48	002557	洽洽食品	6,257,188.14	4.48
49	000050	深天马 A	6,232,293.08	4.47
50	000513	丽珠集团	6,189,515.00	4.44
51	600486	扬农化工	6,098,653.00	4.37
52	601100	恒立液压	6,080,359.78	4.36
53	002920	德赛西威	5,843,036.00	4.19
54	600446	金证股份	5,832,300.00	4.18
55	000800	一汽解放	5,806,945.90	4.16

56	600478	科力远	5,800,107.00	4.16
57	600528	中铁工业	5,787,335.95	4.15
58	603486	科沃斯	5,771,614.68	4.14
59	600737	中粮糖业	5,750,247.00	4.12
60	002019	亿帆医药	5,743,183.00	4.12
61	603338	浙江鼎力	5,741,028.20	4.11
62	600026	中远海能	5,734,319.00	4.11
63	600639	浦东金桥	5,726,809.00	4.10
64	603056	德邦股份	5,690,626.00	4.08
65	002511	中顺洁柔	5,647,034.24	4.05
66	000547	航天发展	5,632,009.00	4.04
67	002266	浙富控股	5,569,852.80	3.99
68	000400	许继电气	5,562,831.50	3.99
69	600808	马钢股份	5,521,303.00	3.96
70	002080	中材科技	5,508,352.00	3.95
71	002281	光迅科技	5,455,300.55	3.91
72	002444	巨星科技	5,359,884.00	3.84
73	002583	海能达	5,290,594.00	3.79
74	600153	建发股份	5,224,788.88	3.74
75	300482	万孚生物	5,172,587.41	3.71
76	600633	浙数文化	5,171,320.26	3.71
77	601168	西部矿业	5,140,736.84	3.68
78	002174	游族网络	5,062,599.74	3.63
79	601811	新华文轩	5,030,794.00	3.60
80	002439	启明星辰	5,013,893.22	3.59
81	002156	通富微电	5,005,172.00	3.59
82	300558	贝达药业	4,974,262.00	3.56
83	002385	大北农	4,961,558.00	3.56
84	600022	山东钢铁	4,891,892.00	3.51
85	603317	天味食品	4,866,886.00	3.49
86	002408	齐翔腾达	4,845,853.18	3.47

87	002064	华峰氨纶	4,812,520.00	3.45
88	300088	长信科技	4,801,286.99	3.44
89	002705	新宝股份	4,768,571.91	3.42
90	000987	越秀金控	4,747,813.00	3.40
91	000488	晨鸣纸业	4,696,967.78	3.37
92	000156	华数传媒	4,683,943.00	3.36
93	000690	宝新能源	4,647,257.68	3.33
94	000712	锦龙股份	4,640,442.00	3.33
95	600039	四川路桥	4,607,521.00	3.30
96	600572	康恩贝	4,595,202.00	3.29
97	000636	风华高科	4,561,610.00	3.27
98	002745	木林森	4,486,828.05	3.22
99	600125	铁龙物流	4,437,578.80	3.18
100	600739	辽宁成大	4,409,449.86	3.16
101	002244	滨江集团	4,363,032.37	3.13
102	002640	跨境通	4,351,299.00	3.12
103	002233	塔牌集团	4,286,905.49	3.07
104	600901	江苏租赁	4,278,733.00	3.07
105	600132	重庆啤酒	4,184,167.00	3.00
106	002128	露天煤业	4,179,320.44	2.99
107	601200	上海环境	4,170,050.00	2.99
108	000581	威孚高科	4,162,535.70	2.98
109	600410	华胜天成	4,080,896.00	2.92
110	600056	中国医药	4,064,283.00	2.91
111	601098	中南传媒	4,059,485.00	2.91
112	002375	亚厦股份	4,027,485.13	2.89
113	000739	普洛药业	4,010,997.00	2.87
114	600811	东方集团	3,907,036.08	2.80
115	603606	东方电缆	3,863,449.00	2.77
116	300166	东方国信	3,780,059.12	2.71
117	600657	信达地产	3,751,937.00	2.69

118	600535	天士力	3,745,091.15	2.68
119	002926	华西证券	3,729,691.00	2.67
120	600466	蓝光发展	3,715,708.00	2.66
121	300607	拓斯达	3,701,330.38	2.65
122	000826	启迪环境	3,693,704.50	2.65
123	603208	江山欧派	3,646,810.80	2.61
124	600720	祁连山	3,631,105.00	2.60
125	300274	阳光电源	3,609,144.52	2.59
126	000988	华工科技	3,583,861.00	2.57
127	300133	华策影视	3,543,887.40	2.54
128	002429	兆驰股份	3,543,633.00	2.54
129	603301	振德医疗	3,537,588.60	2.53
130	002131	利欧股份	3,519,124.00	2.52
131	000898	鞍钢股份	3,511,486.74	2.52
132	000930	中粮科技	3,477,725.00	2.49
133	600460	士兰微	3,477,231.20	2.49
134	600765	中航重机	3,465,271.00	2.48
135	002818	富森美	3,443,958.90	2.47
136	600787	中储股份	3,441,287.00	2.47
137	601233	桐昆股份	3,422,134.85	2.45
138	600875	东方电气	3,398,920.00	2.44
139	002387	维信诺	3,386,943.00	2.43
140	600266	城建发展	3,368,253.00	2.41
141	601000	唐山港	3,361,922.00	2.41
142	601801	皖新传媒	3,310,100.00	2.37
143	002138	顺络电子	3,306,820.63	2.37
144	300474	景嘉微	3,269,947.30	2.34
145	603686	龙马环卫	3,250,813.00	2.33
146	002250	联化科技	3,240,676.00	2.32
147	600017	日照港	3,240,416.00	2.32
148	000750	国海证券	3,238,584.00	2.32

149	300459	金科文化	3,224,763.00	2.31
150	002407	多氟多	3,224,629.00	2.31
151	002635	安洁科技	3,223,590.98	2.31
152	601106	中国一重	3,212,544.00	2.30
153	603345	安井食品	3,205,387.81	2.30
154	000959	首钢股份	3,196,755.00	2.29
155	601899	紫金矿业	3,193,316.00	2.29
156	300257	开山股份	3,158,884.35	2.26
157	600507	方大特钢	3,153,879.00	2.26
158	002648	卫星石化	3,147,156.00	2.26
159	600745	闻泰科技	3,140,832.00	2.25
160	603416	信捷电气	3,135,685.80	2.25
161	002093	国脉科技	3,124,847.56	2.24
162	002493	荣盛石化	3,122,441.15	2.24
163	600959	江苏有线	3,115,298.08	2.23
164	002595	豪迈科技	3,114,551.32	2.23
165	600985	淮北矿业	3,104,688.11	2.22
166	300770	新媒股份	3,104,416.73	2.22
167	600895	张江高科	3,066,199.84	2.20
168	601128	常熟银行	3,042,625.60	2.18
169	600339	中油工程	3,030,344.00	2.17
170	000039	中集集团	3,020,217.00	2.16
171	002959	小熊电器	3,014,962.00	2.16
172	000937	冀中能源	3,012,795.00	2.16
173	300315	掌趣科技	2,998,202.00	2.15
174	600409	三友化工	2,982,393.00	2.14
175	000887	中鼎股份	2,958,100.00	2.12
176	600325	华发股份	2,939,431.20	2.11
177	600598	北大荒	2,937,377.00	2.10
178	600835	上海机电	2,931,471.00	2.10
179	300815	玉禾田	2,917,226.00	2.09

180	600645	中源协和	2,916,778.82	2.09
181	002001	新和成	2,916,282.68	2.09
182	000012	南玻 A	2,879,053.00	2.06
183	000877	天山股份	2,810,931.00	2.01
184	600675	中华企业	2,808,421.20	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603568	伟明环保	11,496,302.40	8.24
2	603444	吉比特	11,423,937.00	8.19
3	600216	浙江医药	11,320,972.69	8.11
4	601615	明阳智能	10,968,146.54	7.86
5	600845	宝信软件	10,960,241.72	7.85
6	002709	天赐材料	10,798,670.79	7.74
7	603866	桃李面包	10,184,258.72	7.30
8	000807	云铝股份	10,045,662.00	7.20
9	600195	中牧股份	9,821,667.89	7.04
10	300002	神州泰岳	9,818,774.35	7.04
11	300418	昆仑万维	9,746,640.06	6.98
12	002414	高德红外	9,722,686.70	6.97
13	600770	综艺股份	9,361,609.96	6.71
14	603233	大参林	9,298,955.12	6.66
15	002030	达安基因	9,283,696.38	6.65
16	300115	长盈精密	8,696,165.32	6.23
17	002223	鱼跃医疗	8,690,541.13	6.23
18	601865	福莱特	8,601,470.22	6.16
19	002416	爱施德	8,543,262.12	6.12
20	000090	天健集团	8,513,967.36	6.10
21	600874	创业环保	8,476,641.04	6.07

22	600143	金发科技	8,132,195.10	5.83
23	002382	蓝帆医疗	7,982,377.17	5.72
24	002028	思源电气	7,853,318.84	5.63
25	000600	建投能源	7,658,724.84	5.49
26	300618	寒锐钴业	7,591,895.59	5.44
27	002603	以岭药业	7,529,238.00	5.40
28	601689	拓普集团	7,523,270.24	5.39
29	601966	玲珑轮胎	7,488,539.37	5.37
30	600064	南京高科	7,453,376.00	5.34
31	600298	安琪酵母	7,262,913.19	5.20
32	601717	郑煤机	7,181,860.32	5.15
33	600521	华海药业	7,180,228.64	5.15
34	300316	晶盛机电	7,006,902.77	5.02
35	600549	厦门钨业	6,971,342.13	5.00
36	002124	天邦股份	6,939,821.19	4.97
37	601799	星宇股份	6,716,991.11	4.81
38	600704	物产中大	6,691,637.68	4.80
39	000975	银泰黄金	6,652,931.99	4.77
40	603806	福斯特	6,573,421.00	4.71
41	000932	华菱钢铁	6,518,935.28	4.67
42	603882	金域医学	6,481,432.00	4.64
43	000050	深天马 A	6,455,972.18	4.63
44	300496	中科创达	6,432,820.47	4.61
45	600060	海信视像	6,375,550.51	4.57
46	002434	万里扬	6,364,598.00	4.56
47	601100	恒立液压	6,348,809.59	4.55
48	600486	扬农化工	6,278,594.45	4.50
49	603486	科沃斯	6,261,659.00	4.49
50	002920	德赛西威	6,238,921.14	4.47
51	000987	越秀金控	6,195,569.00	4.44
52	002019	亿帆医药	6,164,861.50	4.42

53	600201	生物股份	6,146,137.00	4.40
54	002507	涪陵榨菜	6,130,032.13	4.39
55	600478	科力远	6,058,272.50	4.34
56	002583	海能达	6,012,951.00	4.31
57	002080	中材科技	5,929,270.00	4.25
58	000800	一汽解放	5,907,732.68	4.23
59	002557	洽洽食品	5,765,839.92	4.13
60	002511	中顺洁柔	5,721,649.84	4.10
61	000513	丽珠集团	5,716,476.15	4.10
62	002444	巨星科技	5,697,182.17	4.08
63	600528	中铁工业	5,670,348.33	4.06
64	600639	浦东金桥	5,628,015.91	4.03
65	600808	马钢股份	5,601,145.00	4.01
66	600026	中远海能	5,571,159.16	3.99
67	600446	金证股份	5,565,565.58	3.99
68	000400	许继电气	5,561,381.98	3.99
69	000547	航天发展	5,554,710.00	3.98
70	002174	游族网络	5,381,854.02	3.86
71	600153	建发股份	5,381,815.48	3.86
72	002266	浙富控股	5,359,976.50	3.84
73	002281	光迅科技	5,271,124.00	3.78
74	600737	中粮糖业	5,173,503.00	3.71
75	002385	大北农	5,125,050.00	3.67
76	300088	长信科技	5,099,458.32	3.65
77	603338	浙江鼎力	5,084,386.00	3.64
78	601811	新华文轩	5,013,035.84	3.59
79	002439	启明星辰	4,996,035.32	3.58
80	600022	山东钢铁	4,992,363.00	3.58
81	300558	贝达药业	4,988,789.06	3.57
82	603056	德邦股份	4,939,362.80	3.54
83	600633	浙数文化	4,824,390.37	3.46

84	600572	康恩贝	4,751,517.64	3.40
85	002064	华峰氨纶	4,749,675.38	3.40
86	002640	跨境通	4,740,666.00	3.40
87	002408	齐翔腾达	4,697,467.58	3.37
88	300274	阳光电源	4,666,695.03	3.34
89	000712	锦龙股份	4,619,242.00	3.31
90	002156	通富微电	4,578,385.00	3.28
91	600125	铁龙物流	4,468,437.02	3.20
92	600132	重庆啤酒	4,466,073.00	3.20
93	600811	东方集团	4,401,226.39	3.15
94	601168	西部矿业	4,312,494.00	3.09
95	002705	新宝股份	4,311,760.84	3.09
96	002375	亚厦股份	4,273,000.96	3.06
97	000488	晨鸣纸业	4,254,949.40	3.05
98	603606	东方电缆	4,208,632.00	3.02
99	300482	万孚生物	4,192,865.74	3.00
100	601200	上海环境	4,187,126.98	3.00
101	002233	塔牌集团	4,135,270.00	2.96
102	000636	风华高科	4,108,548.00	2.94
103	000690	宝新能源	4,091,088.00	2.93
104	000156	华数传媒	4,032,560.00	2.89
105	002244	滨江集团	4,020,940.52	2.88
106	603317	天味食品	4,007,088.00	2.87
107	600056	中国医药	3,968,607.00	2.84
108	600657	信达地产	3,964,309.00	2.84
109	600410	华胜天成	3,907,088.00	2.80
110	002745	木林森	3,811,964.40	2.73
111	000826	启迪环境	3,772,027.60	2.70
112	300459	金科文化	3,752,490.00	2.69
113	600466	蓝光发展	3,734,619.00	2.68
114	300607	拓斯达	3,647,030.78	2.61

115	002429	兆驰股份	3,635,457.00	2.61
116	000739	普洛药业	3,626,943.00	2.60
117	603208	江山欧派	3,599,254.30	2.58
118	300133	华策影视	3,587,829.00	2.57
119	600901	江苏租赁	3,584,144.00	2.57
120	601801	皖新传媒	3,574,141.00	2.56
121	600039	四川路桥	3,566,695.00	2.56
122	600787	中储股份	3,533,639.00	2.53
123	000930	中粮科技	3,494,945.00	2.50
124	603301	振德医疗	3,493,008.90	2.50
125	002131	利欧股份	3,467,493.00	2.48
126	002635	安洁科技	3,457,875.23	2.48
127	600720	祁连山	3,436,879.00	2.46
128	002387	维信诺	3,434,557.00	2.46
129	002128	露天煤业	3,428,924.48	2.46
130	600875	东方电气	3,422,558.20	2.45
131	600707	彩虹股份	3,418,428.88	2.45
132	600266	城建发展	3,416,654.02	2.45
133	300166	东方国信	3,397,554.15	2.43
134	000898	鞍钢股份	3,390,009.70	2.43
135	603416	信捷电气	3,367,628.00	2.41
136	002493	荣盛石化	3,361,459.46	2.41
137	000581	威孚高科	3,334,757.46	2.39
138	600745	闻泰科技	3,330,972.32	2.39
139	601106	中国一重	3,300,603.00	2.37
140	600535	天士力	3,297,100.00	2.36
141	002407	多氟多	3,280,977.50	2.35
142	600739	辽宁成大	3,262,379.00	2.34
143	000750	国海证券	3,243,145.00	2.32
144	601899	紫金矿业	3,239,480.00	2.32
145	300690	双一科技	3,237,786.00	2.32

146	600017	日照港	3,237,096.74	2.32
147	002959	小熊电器	3,156,737.20	2.26
148	600985	淮北矿业	3,156,303.57	2.26
149	601098	中南传媒	3,135,147.00	2.25
150	300770	新媒股份	3,113,015.75	2.23
151	000012	南玻A	3,109,321.02	2.23
152	000988	华工科技	3,058,856.00	2.19
153	002093	国脉科技	3,015,385.28	2.16
154	600325	华发股份	2,995,410.00	2.15
155	002926	华西证券	2,985,033.00	2.14
156	600598	北大荒	2,982,063.00	2.14
157	600895	张江高科	2,955,228.00	2.12
158	000039	中集集团	2,953,491.70	2.12
159	002818	富森美	2,946,442.90	2.11
160	000959	首钢股份	2,940,674.16	2.11
161	300815	玉禾田	2,939,896.00	2.11
162	603686	龙马环卫	2,938,507.40	2.11
163	603345	安井食品	2,898,364.00	2.08
164	002001	新和成	2,892,560.46	2.07
165	002648	卫星石化	2,876,047.00	2.06
166	002002	鸿达兴业	2,860,489.86	2.05
167	300474	景嘉微	2,855,624.19	2.05
168	300617	安靠智电	2,837,500.55	2.03
169	002138	顺络电子	2,812,580.99	2.02
170	002250	联化科技	2,803,727.00	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,780,285,906.96
卖出股票收入（成交）总额	1,702,997,298.04

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	2,691.40
5	应收申购款	322,538.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	325,229.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
中信 建投 中证5 00增 强A	1,244	50,061.48	0.00	0.00%	62,276,486.95	100.00%
中信	1,259	35,519.95	6,913,353.78	15.4593%	37,806,260.53	84.5407%

建投 中证5 00增 强C						
合计	2,472	43,283.21	6,913,353.78	6.4613%	100,082,747.48	93.5387%

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	中信建投中证500增强A	35,313.32	0.0567%
	中信建投中证500增强C	61,793.09	0.1382%
	合计	97,106.41	0.0908%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放 式基金	中信建投中证500增强A	0
	中信建投中证500增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	中信建投中证500增强A	0
	中信建投中证500增强C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
基金合同生效日(2020年05月09 日)基金份额总额	109,947,302.18	162,449,314.06
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	59,052,073.96	69,267,196.99
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	106,722,889.19	186,996,896.74
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

基金拆分变动份额		
本报告期期末基金份额总额	62, 276, 486. 95	44, 719, 614. 31

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020年5月22日，邱黎强先生不再担任基金管理人总经理，董事长蒋月勤先生代行总经理职务。

2020年5月31日，周建萍女士不再担任基金管理人副总经理。

2020年6月19日，金强先生担任基金管理人总经理，董事长蒋月勤先生不再代行总经理职务。

2020年12月30日，袁野先生不再担任基金管理人常务副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

团队系统性的迭代更新了量化模型，在模型中加入了人工智能AI算法，通过算法来自适应市场各种风格的变化，以保障模型更有效地运转。同时，为了应对潜在的机构抱团现象的长期存在，团队正在积极开发轮动模型，预判行业/风格的趋势性，并超配相关的股票。力争在超额收益的基础外，博取额外的择时收益。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元整，该审计机构自本基金合同生效之日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员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	
中信证券（券商柜台）	2	3,477,285,909.99	100.00%	6,113,993.88	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券（券商柜台）	-	-	648,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司投资部负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）投资部每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。投资部根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

(3) 评估实行评分制，具体如下：

分配权重(100分)=基础研究服务(70%)+特别研究服务(15%)+综合研究服务(15%)。

基础研究服务占70%权重，由投资部负责人、研究部负责人、基金经理和研究员负责打分；特别研究服务占15%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分；综合研究服务占15%权重，由投资部负责人、研究部负责人和投资部行政秘书负责打分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

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	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定网站	2020-04-03
2	中信建投中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定网站	2020-04-03
3	中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定网站	2020-04-03
4	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-04-03
5	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-03
6	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加中信证券（山东）有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-14
7	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加北京农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-20
8	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加中信期货有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-21

9	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-05-06
10	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-05-10
11	中信建投基金管理有限公司关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资科创板上市股票及相关风险揭示的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-05-21
12	中信建投基金管理公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-05-23
13	中信建投基金管理公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-06-02
14	中信建投中证500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-06-08
15	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金暂停在直销中心开通定投业务及定投费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-06-10
16	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金在代销机构开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-06-10
17	中信建投基金管理公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-06-20
18	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金开通网上直销平台申购、赎回、定投业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-08-12

19	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2020-09-01
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-09-07
21	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年第3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-10-28
22	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2020年第3季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-10-28
23	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-10-31
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-11-03
25	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构及开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-11-16
26	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加代销机构及开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-11-23
27	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-08
28	中信建投基金管理有限公司	中国证监会规定报刊及规定	2020-12-11

	关于旗下部分证券投资基金修订基金合同、托管协议的公告	网站	
29	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-11
30	中信建投中证500指数增强型证券投资基金托管协议（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-11
31	中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-16
32	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-16
33	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-23
34	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-31

§ 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，未出现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，无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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；

- 3、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二一年三月三十一日