

# 中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（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2021年1月1日起至2021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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	73
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	73
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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
9.4 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.....	76
§10 开放式基金份额变动.....	76
§11 重大事件揭示.....	77
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§13 备查文件目录.....	80
13.1 备查文件目录.....	80
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中融中证500ETF
场内简称	中融500（基金扩位简称：中融中证500ETF）
基金主代码	515550
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019年11月15日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,345,700.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-12-25

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中融基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	95595
传真	010-56517001	010-63639132
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市朝阳区望京东园四区2号楼17层1701号01室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100102	100033
法定代表人	王瑶	李晓鹏

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	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	上会会计师事务所(特殊普通)	上海市静安区威海路755号文新报业

	合伙)	大厦25楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标、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	2021年	2020年	2019年11月15日（基金合同生效日）-2019年12月31日
本期已实现收益	6,124,813.45	27,858,272.98	5,458,078.58
本期利润	5,216,581.05	26,096,704.52	10,262,680.75
加权平均基金份额本期利润	0.2382	0.3006	0.0455
本期加权平均净值利润率	17.18%	26.36%	4.49%
本期基金份额净值增长率	18.09%	22.86%	4.94%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	10,107,857.68	10,225,149.35	3,552,335.27
期末可供分配基金份额利润	0.5225	0.2893	0.0337
期末基金资产净值	29,453,557.68	45,570,849.35	110,548,952.18
期末基金份额净值	1.5225	1.2893	1.0494
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	52.25%	28.93%	4.94%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.74%	0.73%	3.60%	0.76%	0.14%	-0.03%
过去六个月	8.86%	0.93%	8.10%	0.96%	0.76%	-0.03%
过去一年	18.09%	0.94%	15.58%	0.97%	2.51%	-0.03%
自基金合同生效起至今	52.25%	1.23%	49.82%	1.31%	2.43%	-0.08%

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

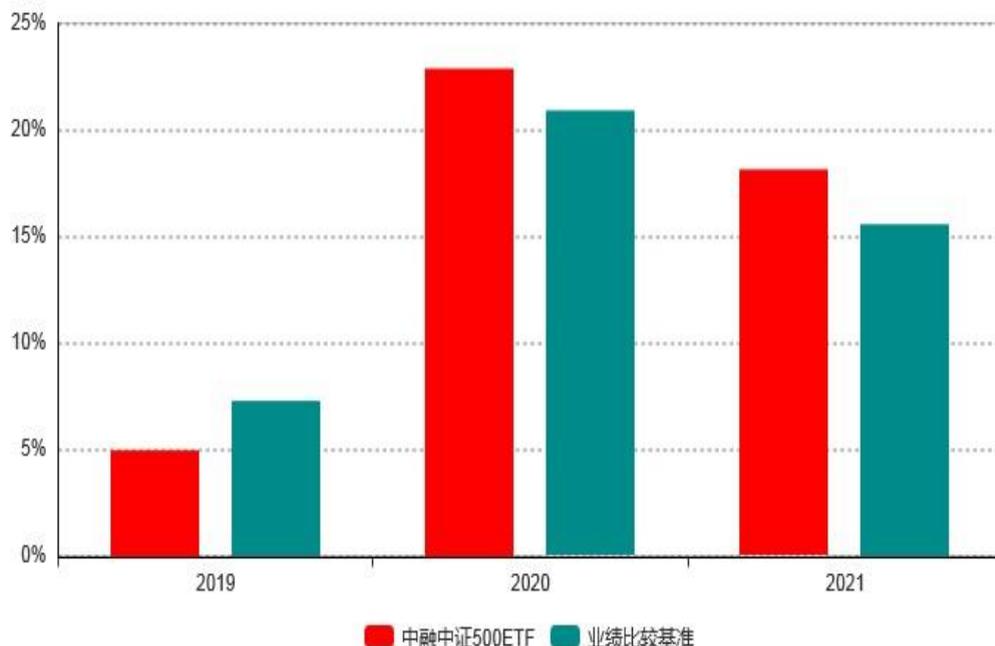
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月15日-2021年12月31日)



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

## 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：本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

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2021年12月31日，中融基金管理有限公司共管理73只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合

型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
赵菲	中融中证银行指数证券投资基金 (LOF)、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及数量投资部联席总经理。	2019-11-15	-	13	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限13年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部联席总经理。
陈薪羽	中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资	2019-11-28	-	6	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限6年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部基金经理。

	基金的基金经理。				
--	----------	--	--	--	--

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 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。

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

2021年，A股市场区间震荡，板块热点此起彼伏，中证500指数上涨15.58%，本基金作为一只投资于中证500指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融500基金份额净值为1.5225元，本报告期内，基金份额净值增长率为18.09%，同期业绩比较基准收益率为15.58%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2021年，全球经济在疫情不断演变中继续复苏，年初全球通胀引发了市场高度关注，这可能是疫情后巨幅需求刺激叠加暂时性的供给弹性不足导致的，且视各国国情而有差异。对中长期物价来说，虽然当期是周期性因素占主导，但“碳中和”和“逆全球化”的趋势使得后续走势更加复杂。随着“保供顺价”的政策陆续出台，我国的供给已经开始增加，但需求仍有下行压力，最明显的就是下半年政策管控下的煤炭。2021年结构性改革，加强反垄断、反对资本无序扩张、教育改革推进以及医保集采的力度，都让投资者印象深刻。反观A股，主要指数表现分化，沪深300跑输中证500和创业板等中小盘指数，板块轮动加快，上半年上市公司业绩整体表现较优，但下半年随着经济增长放缓，盈利压力显现，估值水平出现整体下滑，部分板块由于政策调控影响也有较大幅度的下跌。

展望2022年，整体受地产下行压力、出口增速回落以及固定投资增速缺乏弹性的影响，预期宏观经济仍将维持略微下行趋势。当前的宏观环境，货币政策“稳中有松”，趋松的拐点从2021年7月下旬的降准开始，随着9月底能源商品的“保供稳价”和稳房地产信号的进一步明确，以及面临保经济增长的压力，2022年政策放松力度有望进一步加强。

在流动性宽松的预期下，高景气度、高增长的行业仍将受到青睐。2022年，预计共同富裕政策框架的进一步完善将推进科技创新和产业升级、碳达峰和碳中和以及高质量、均衡的产业发展，也将促进相应的财政改革和金融资本市场的进一步开放。

随着A股市场广度和深度不断进步，过去以某一宽基指数界定A股市场投资机会的时代可能已经结束，而基于行业、板块、个股的基本面变化的结构行情贯穿始终。在货币财政政策偏宽松的2022年，估值支撑存在压力，市场结构或许更加均衡。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 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及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

本报告期内，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中融中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生

任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 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	上会师报字(2022)第2301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	中融中证500交易型开放式指数证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了中融中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中融500”)财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021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,后附中融500的财务报表

	<p>在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中融500 2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则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，我们独立于中融500，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融500管理人（以下简称“管理人”）根据《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融500份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括中融500 2021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</p>

	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	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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，管理人负责评估中融500的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于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、评价管理人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</p>

	<p>管理人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，就可能导致对中融500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融500不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融500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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	胡治华	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼	
审计报告日期	2022-03-24	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,732,601.24	2,842,911.43
结算备付金		641,642.74	495,926.98
存出保证金		208,120.36	551,504.19
交易性金融资产	7.4.7.2	26,881,077.15	41,802,779.04

其中：股票投资		26,871,670.75	41,802,779.04
基金投资		-	-
债券投资		9,406.40	-
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		31,924.11	426.53
应收利息	7.4.7.5	701.54	848.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		29,496,067.14	45,694,396.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	17,342.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,427.68	11,843.40
应付托管费		2,475.89	3,947.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,017.46	20,645.03
应交税费		1,424.90	4,767.94
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	22,163.53	65,000.00
负债合计		42,509.46	123,546.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	19,345,700.00	35,345,700.00
未分配利润	7.4.7.10	10,107,857.68	10,225,149.35
所有者权益合计		29,453,557.68	45,570,849.35
负债和所有者权益总计		29,496,067.14	45,694,396.23

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额 19,345,700.00 份，份额净值1.5225元。

## 7.2 利润表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
<b>一、收入</b>		5,457,109.81	27,361,730.53
1. 利息收入		22,424.29	80,783.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,420.76	80,783.29
债券利息收入		3.53	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,294,849.85	28,016,738.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,522,784.84	25,602,937.20

基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	2,332.26	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	412,194.17	1,494,796.12
股利收益	7.4.7.17	357,538.58	919,004.75
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.18	-908,232.40	-1,761,568.46
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.19	48,068.07	1,025,777.63
<b>减：二、费用</b>		240,528.76	1,265,026.01
1. 管理人报酬		91,262.36	295,191.18
2. 托管费		30,420.86	98,397.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	88,235.44	696,056.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		1,483.89	5,381.26
7. 其他费用	7.4.7.21	29,126.21	170,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		5,216,581.05	26,096,704.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		5,216,581.05	26,096,704.52

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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)	35,345,700.00	10,225,149.35	45,570,849.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,216,581.05	5,216,581.05
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)	-16,000,000.00	-5,333,872.72	-21,333,872.72
其中：1. 基金申购款	2,000,000.00	920,107.23	2,920,107.23
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-6,253,979.95	-24,253,979.95
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)	19,345,700.00	10,107,857.68	29,453,557.68
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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)	105,345,700.00	5,203,252.18	110,548,952.18
二、本期经营活动产生的基金净值	-	26,096,704.52	26,096,704.52

变动数(本期利润)			
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)	-70,000,000.00	-21,074,807.35	-91,074,807.35
其中: 1. 基金申购款	238,000,000.00	20,390,980.89	258,390,980.89
2. 基金赎回款	-308,000,000.00	-41,465,788.24	-349,465,788.24
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)	35,345,700.00	10,225,149.35	45,570,849.35

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:

王瑶

曹健

李克

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

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1304号文《关于准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》批准,由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2019年11月15日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金募集期为2019年9月3日至2019年11月8日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金235,339,130.00元,折合235,339,130.00份

中融500基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币6,570.00元,折合6,570份中融500基金份额,以上收到的实收基金共计人民币235,345,700.00元,折合235,345,700份中融500基金份额,有效认购户数为3637户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

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》和基金合同等有关规定,本基金主要投资于标的指数即中证500指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为中证500指数收益率。

本基金的财务报表于2022年3月24日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021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

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币,记账本位币单位为元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

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

#### 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起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本

基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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

##### (2) 投资收益

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

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

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

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

##### (3) 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的指数许可费按《基金合同》约定的方法进行计提。

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

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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为现金分红；

(3) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见招募说明书；

(4) 本基金以使收益分配后份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(5) 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(6) 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

无。

#### 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，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民

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

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

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

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

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

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

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

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

## 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

活期存款	1,732,601.24	2,842,911.43
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	1,732,601.24	2,842,911.43

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,780,530.94	26,871,670.75	2,091,139.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	9,406.40	1,406.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,000.00	9,406.40	1,406.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		24,788,530.94	26,881,077.15	2,092,546.21
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		38,808,075.57	41,802,779.04	2,994,703.47
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	38,808,075.57	41,802,779.04	2,994,703.47

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,417,480.00	-	-	-
—股指期货	1,417,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,417,480.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,700,880.00	-	-	-
—股指期货	3,700,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,700,880.00	-	-	-

注：(1) 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

(2) 于2021年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2203	中证500股指期货2203合约	1	1,461,160.00	43,680.00
总额合计				43,680.00
减：可抵销期货暂收款				43,680.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

(3) 于2020年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2103	中证500股指期货2103合约	3	3,750,840.00	49,960.00
总额合计				49,960.00
减：可抵销期货暂收款				49,960.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021年12月31日	2020年12月31日
应收活期存款利息	390.88	679.56
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	307.11	11.55
应收债券利息	1.79	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.76	156.95
合计	701.54	848.06

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,017.46	20,645.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,017.46	20,645.03

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

预提费用	20,000.00	30,000.00
应付指数使用费	2,163.53	35,000.00
合计	22,163.53	65,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,345,700.00	35,345,700.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
本期末	19,345,700.00	19,345,700.00

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,625,987.28	-4,400,837.93	10,225,149.35
本期利润	6,124,813.45	-908,232.40	5,216,581.05
本期基金份额交易产生的变动数	-7,437,720.59	2,103,847.87	-5,333,872.72
其中：基金申购款	1,194,357.14	-274,249.91	920,107.23
基金赎回款	-8,632,077.73	2,378,097.78	-6,253,979.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,313,080.14	-3,205,222.46	10,107,857.68

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	13,866.90	59,888.97

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	8,427.12	19,226.09
其他	126.74	1,668.23
合计	22,420.76	80,783.29

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至20 20年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,399,303.67	17,377,028.44
股票投资收益——赎回差价收入	1,123,481.17	8,225,908.76
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	5,522,784.84	25,602,937.20

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	36,450,454.57	273,511,928.19
减：卖出股票成本总额	32,051,150.90	256,134,899.75
买卖股票差价收入	4,399,303.67	17,377,028.44

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日

赎回基金份额对价总额	24,253,979.95	349,465,788.24
减：现金支付赎回款总额	13,106,250.95	191,826,577.24
减：赎回股票成本总额	10,024,247.83	149,413,302.24
赎回差价收入	1,123,481.17	8,225,908.76

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,332.26	-
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	2,332.26	-

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑	8,334.00	-

付) 成交总额		
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	6,000.00	-
减: 应收利息总额	1.74	-
买卖债券差价收入	2,332.26	-

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

注: 无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注: 无。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注: 无。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
期货投资	412,194.17	1,494,796.12

#### 7.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	357,538.58	919,004.75
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	357,538.58	919,004.75

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-902,157.26	-1,809,898.70
——股票投资	-903,563.66	-1,809,898.70
——债券投资	1,406.40	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-6,280.00	49,960.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-6,280.00	49,960.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-204.86	1,629.76
合计	-908,232.40	-1,761,568.46

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	16,775.84	1,025,777.43
其他	31,292.23	0.20
合计	48,068.07	1,025,777.63

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	87,843.24	695,311.23
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	392.20	745.31
合计	88,235.44	696,056.54

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	20,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
指数使用费	9,126.21	140,000.00
上市费	0.00	0.00
合计	29,126.21	170,000.00

#### 7.4.7.22 分部报告

无。

#### 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

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中融中证500ETF联接”）	基金管理人管理的其他基金

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**

注：无。

**7.4.10.1.2 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

注：无。

**7.4.10.1.5 基金交易**

注：无。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

注：无。

## 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 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	91,262.36	295,191.18
其中：支付销售机构的客户维护费	-	0.00

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，每日计提，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 X 0.30% / 当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	30,420.86	98,397.03

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，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 X 0.10% / 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

注：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

注：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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中融中证500 ETF联接	14,177,200.00	73.28%	28,874,000.00	81.69%

#### 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	1,732,601.24	13,866.90	2,842,911.43	59,888.97

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 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

注：无。

#### 7.4.12 期末（2021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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未流通	16.53	16.53	138	2,281.14	2,281.14	-

#### 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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021-1-1 2021-2-2 2021-2-0	重大资产重组	30.12	2021-2-0 2021-1-0 2021-4	31.00	1,700	57,327.63	51,204.00	-

#### 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

注：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。

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

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

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

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	9,406.40	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	9,406.40	-

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

**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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现

金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,732,601.24	-	-	-	1,732,601.24
结算备付金	641,642.74	-	-	-	641,642.74
存出保证金	208,120.36	-	-	-	208,120.36
交易性金融资产	9,406.40	-	-	26,871,670.75	26,881,077.15
应收证券清算	-	-	-	31,924.11	31,924.11

款					
应收利息	-	-	-	701.54	701.54
资产总计	2,591,770.74	-	-	26,904,296.40	29,496,067.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,427.68	7,427.68
应付托管费	-	-	-	2,475.89	2,475.89
应付交易费用	-	-	-	9,017.46	9,017.46
应交税费	-	-	-	1,424.90	1,424.90
其他负债	-	-	-	22,163.53	22,163.53
负债总计	-	-	-	42,509.46	42,509.46
利率敏感度缺口	2,591,770.74	-	-	26,861,786.94	29,453,557.68
上年度末 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	2,842,911.43	-	-	-	2,842,911.43
结算备付金	495,926.98	-	-	-	495,926.98
存出保证金	551,504.19	-	-	-	551,504.19
交易性金融资产	-	-	-	41,802,779.04	41,802,779.04
应收证券清算款	-	-	-	426.53	426.53
应收利息	-	-	-	848.06	848.06
资产总计	3,890,342.60	-	-	41,804,053.63	45,694,396.23
负债					

应付证券清算款	-	-	-	17,342.71	17,342.71
应付管理人报酬	-	-	-	11,843.40	11,843.40
应付托管费	-	-	-	3,947.80	3,947.80
应付交易费用	-	-	-	20,645.03	20,645.03
应交税费	-	-	-	4,767.94	4,767.94
其他负债	-	-	-	65,000.00	65,000.00
负债总计	-	-	-	123,546.88	123,546.88
利率敏感度缺口	3,890,342.60	-	-	41,680,506.75	45,570,849.35

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

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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 2021年12月31日		上年度末 2020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	26,871,670.75	91.23	41,802,779.04	91.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,406.40	0.03	-	-
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	26,881,077.15	91.27	41,802,779.04	91.73

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数上升5%	847,443.40	2,204,754.84

	沪深300指数下降5%	-847, 443. 40	-2, 204, 754. 84
--	-------------	---------------	------------------

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

#### 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

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### ① 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

###### ② 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币26,827,592.01元，属于第二层次的余额为人民币53,485.14元，无属于第三层次的余额。（2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币41,738,704.11元，属于第二层次的余额为64,074.93元，无属于第三层次的余额）

###### ③ 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	26,871,670.75	91.10
	其中：股票	26,871,670.75	91.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,406.40	0.03
	其中：债券	9,406.40	0.03
	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	2,374,243.98	8.05
8	其他各项资产	240,746.01	0.82
9	合计	29,496,067.14	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	302,739.20	1.03
B	采矿业	1,053,566.60	3.58
C	制造业	16,209,765.72	55.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,047,622.08	3.56
E	建筑业	519,815.00	1.76
F	批发和零售业	829,490.20	2.82

G	交通运输、仓储和邮政业	638,056.09	2.17
H	住宿和餐饮业	157,106.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,140,936.90	7.27
J	金融业	2,000,418.96	6.79
K	房地产业	704,777.00	2.39
L	租赁和商务服务业	335,333.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	93,299.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	231,920.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,069.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	351,621.00	1.19
S	综合	198,135.00	0.67
	合计	26,871,670.75	91.23

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002340	格林美	18,700	193,545.00	0.66
2	600522	中天科技	10,400	176,384.00	0.60
3	000733	振华科技	1,400	173,992.00	0.59
4	601555	东吴证券	19,400	171,884.00	0.58
5	000723	美锦能源	10,000	162,300.00	0.55
6	601615	明阳智能	6,100	159,210.00	0.54

7	600157	永泰能源	87,200	158,704.00	0.54
8	600399	抚顺特钢	6,100	151,097.00	0.51
9	600885	宏发股份	2,000	149,280.00	0.51
10	600884	杉杉股份	4,545	148,939.65	0.51
11	000009	中国宝安	10,100	145,743.00	0.49
12	002384	东山精密	5,300	143,630.00	0.49
13	601117	中国化学	11,900	142,800.00	0.48
14	002013	中航机电	7,600	138,168.00	0.47
15	002385	大北农	13,000	136,370.00	0.46
16	300285	国瓷材料	3,100	131,967.00	0.45
17	002180	纳思达	2,700	128,952.00	0.44
18	002268	卫士通	2,300	128,662.00	0.44
19	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.44
20	300088	长信科技	9,600	127,488.00	0.43
21	300037	新宙邦	1,100	124,300.00	0.42
22	600765	中航重机	2,400	121,176.00	0.41
23	605358	立昂微	1,000	120,010.00	0.41
24	600256	广汇能源	18,000	117,720.00	0.40
25	688099	晶晨股份	900	117,180.00	0.40
26	600563	法拉电子	500	116,200.00	0.39
27	600298	安琪酵母	1,900	114,684.00	0.39
28	600862	中航高科	3,200	114,432.00	0.39
29	600141	兴发集团	3,000	113,640.00	0.39
30	002028	思源电气	2,299	113,133.79	0.38
31	300253	卫宁健康	6,700	112,292.00	0.38
32	600487	亨通光电	7,400	111,888.00	0.38
33	002185	华天科技	8,800	111,848.00	0.38
34	000988	华工科技	3,900	108,654.00	0.37
35	600392	盛和资源	5,500	107,910.00	0.37
36	601636	旗滨集团	6,300	107,730.00	0.37
37	300363	博腾股份	1,200	107,340.00	0.36

38	603456	九洲药业	1,900	106,894.00	0.36
39	600418	江淮汽车	6,000	104,400.00	0.35
40	300058	蓝色光标	9,700	104,081.00	0.35
41	688005	容百科技	900	104,022.00	0.35
42	300699	光威复材	1,200	101,376.00	0.34
43	601168	西部矿业	7,400	100,714.00	0.34
44	000630	铜陵有色	28,900	100,572.00	0.34
45	600754	锦江酒店	1,700	99,620.00	0.34
46	603589	口子窖	1,400	99,218.00	0.34
47	603613	国联股份	900	96,750.00	0.33
48	002797	第一创业	13,200	96,624.00	0.33
49	600516	方大炭素	8,900	96,298.00	0.33
50	300136	信维通信	3,800	96,216.00	0.33
51	002138	顺络电子	2,500	95,450.00	0.32
52	000998	隆平高科	4,100	95,366.00	0.32
53	300223	北京君正	700	93,800.00	0.32
54	601077	渝农商行	24,300	93,555.00	0.32
55	600875	东方电气	4,300	92,106.00	0.31
56	600486	扬农化工	700	91,840.00	0.31
57	000728	国元证券	11,900	91,630.00	0.31
58	300724	捷佳伟创	800	91,440.00	0.31
59	601689	拓普集团	1,700	90,100.00	0.31
60	603267	鸿远电子	500	89,720.00	0.30
61	002409	雅克科技	1,100	89,287.00	0.30
62	300308	中际旭创	2,100	89,250.00	0.30
63	300146	汤臣倍健	3,300	88,968.00	0.30
64	002080	中材科技	2,600	88,452.00	0.30
65	600233	圆通速递	5,300	88,404.00	0.30
66	600038	中直股份	1,100	88,330.00	0.30
67	002212	天融信	4,600	88,182.00	0.30
68	002353	杰瑞股份	2,200	88,000.00	0.30

69	002223	鱼跃医疗	2,300	86,940.00	0.30
70	300418	昆仑万维	3,700	85,655.00	0.29
71	000519	中兵红箭	3,200	85,344.00	0.29
72	002673	西部证券	10,500	84,735.00	0.29
73	600733	北汽蓝谷	8,400	84,168.00	0.29
74	000547	航天发展	5,000	83,500.00	0.28
75	000636	风华高科	2,800	83,440.00	0.28
76	600705	中航产融	21,000	83,370.00	0.28
77	000932	华菱钢铁	16,200	82,782.00	0.28
78	600482	中国动力	4,200	82,740.00	0.28
79	002439	启明星辰	2,900	82,737.00	0.28
80	603077	和邦生物	24,200	82,522.00	0.28
81	000039	中集集团	4,800	82,368.00	0.28
82	600188	兖矿能源	3,500	82,355.00	0.28
83	603893	瑞芯微	600	82,140.00	0.28
84	600739	辽宁成大	4,200	81,984.00	0.28
85	600699	均胜电子	3,700	81,289.00	0.28
86	300296	利亚德	7,900	80,975.00	0.27
87	000739	普洛药业	2,300	80,707.00	0.27
88	688208	道通科技	1,000	79,400.00	0.27
89	002444	巨星科技	2,600	79,326.00	0.27
90	600529	山东药玻	1,800	79,020.00	0.27
91	002465	海格通信	7,200	78,624.00	0.27
92	688002	睿创微纳	1,000	78,570.00	0.27
93	600988	赤峰黄金	5,200	77,480.00	0.26
94	002030	达安基因	3,856	77,351.36	0.26
95	000738	航发控制	2,542	76,971.76	0.26
96	601016	节能风电	11,800	76,818.00	0.26
97	603290	斯达半导	200	76,200.00	0.26
98	000960	锡业股份	3,900	76,167.00	0.26
99	300474	景嘉微	500	76,100.00	0.26

100	000807	云铝股份	6,800	75,956.00	0.26
101	600521	华海药业	3,500	75,810.00	0.26
102	600637	东方明珠	8,000	75,600.00	0.26
102	002507	涪陵榨菜	2,000	75,600.00	0.26
104	600177	雅戈尔	10,900	75,101.00	0.25
105	002273	水晶光电	4,300	74,777.00	0.25
106	600549	厦门钨业	3,300	74,679.00	0.25
107	688065	凯赛生物	400	73,712.00	0.25
108	601198	东兴证券	6,300	73,269.00	0.25
109	600732	爱旭股份	3,100	72,416.00	0.25
110	002078	太阳纸业	6,300	72,387.00	0.25
111	600704	物产中大	12,200	72,224.00	0.25
112	600201	生物股份	4,400	71,940.00	0.24
113	300383	光环新网	4,800	71,232.00	0.24
114	600642	申能股份	9,600	70,752.00	0.24
115	601128	常熟银行	10,700	70,727.00	0.24
116	002299	圣农发展	2,900	70,093.00	0.24
117	600879	航天电子	8,500	70,040.00	0.24
118	002156	通富微电	3,600	69,948.00	0.24
119	688521	芯原股份	900	69,624.00	0.24
120	300763	锦浪科技	300	69,465.00	0.24
121	600497	驰宏锌锗	13,900	69,361.00	0.24
122	603127	昭衍新药	600	69,258.00	0.24
123	600369	西南证券	13,000	68,770.00	0.23
124	300357	我武生物	1,200	68,760.00	0.23
125	600027	华电国际	12,800	68,480.00	0.23
126	600160	巨化股份	5,300	68,423.00	0.23
127	002557	洽洽食品	1,100	67,496.00	0.23
128	600039	四川路桥	5,600	67,424.00	0.23
129	600372	中航电子	3,000	67,170.00	0.23
130	000830	鲁西化工	4,400	67,144.00	0.23

131	002092	中泰化学	7,000	66,780.00	0.23
132	002739	万达电影	4,300	66,564.00	0.23
133	000623	吉林敖东	3,600	66,492.00	0.23
134	000983	山西焦煤	7,980	65,994.60	0.22
135	600580	卧龙电驱	3,600	65,844.00	0.22
136	000629	攀钢钒钛	16,800	65,352.00	0.22
137	002131	利欧股份	26,500	65,190.00	0.22
138	601997	贵阳银行	10,000	65,100.00	0.22
139	002985	北摩高科	540	65,048.40	0.22
140	002249	大洋电机	7,400	65,046.00	0.22
141	002508	老板电器	1,800	64,836.00	0.22
142	002373	千方科技	4,300	64,285.00	0.22
143	300115	长盈精密	3,240	64,281.60	0.22
144	300017	网宿科技	9,600	64,224.00	0.22
145	300618	寒锐钴业	800	64,144.00	0.22
146	002936	郑州银行	20,141	63,645.56	0.22
147	002603	以岭药业	3,240	63,504.00	0.22
148	000825	太钢不锈	8,900	62,656.00	0.21
149	600170	上海建工	17,400	62,640.00	0.21
150	603218	日月股份	1,900	62,605.00	0.21
151	603198	迎驾贡酒	900	62,505.00	0.21
152	600316	洪都航空	1,600	62,496.00	0.21
152	000050	深天马 A	4,800	62,496.00	0.21
154	603605	珀莱雅	300	62,493.00	0.21
155	002422	科伦药业	3,300	62,469.00	0.21
156	600118	中国卫星	2,300	62,445.00	0.21
157	600166	福田汽车	18,000	61,920.00	0.21
158	000750	国海证券	14,900	61,239.00	0.21
159	300070	碧水源	8,500	61,115.00	0.21
160	000887	中鼎股份	2,800	61,068.00	0.21
161	002506	协鑫集成	16,000	60,800.00	0.21

161	002372	伟星新材	2,500	60,800.00	0.21
163	600153	建发股份	6,700	60,769.00	0.21
164	600803	新奥股份	3,300	60,588.00	0.21
165	002191	劲嘉股份	4,000	60,520.00	0.21
166	000027	深圳能源	7,460	60,426.00	0.21
167	600867	通化东宝	5,500	60,280.00	0.20
168	002926	华西证券	6,100	60,085.00	0.20
169	000400	许继电气	2,300	60,030.00	0.20
170	300168	万达信息	4,600	59,892.00	0.20
171	002266	浙富控股	8,400	59,808.00	0.20
172	300001	特锐德	2,400	59,688.00	0.20
173	600909	华安证券	11,000	59,510.00	0.20
174	600859	王府井	2,200	59,400.00	0.20
175	300251	光线传媒	4,600	59,110.00	0.20
176	600236	桂冠电力	9,200	59,064.00	0.20
177	300009	安科生物	4,504	58,957.36	0.20
178	002002	鸿达兴业	9,700	58,782.00	0.20
179	600008	首创环保	17,210	58,686.10	0.20
180	002065	东华软件	7,500	58,500.00	0.20
181	002056	横店东磁	3,100	58,497.00	0.20
182	600066	宇通客车	5,300	58,406.00	0.20
183	000997	新大陆	3,200	57,984.00	0.20
184	600271	航天信息	4,300	57,577.00	0.20
185	600258	首旅酒店	2,200	57,486.00	0.20
186	002408	齐翔腾达	5,460	57,330.00	0.19
187	002203	海亮股份	4,600	57,178.00	0.19
188	603707	健友股份	1,360	57,120.00	0.19
188	002152	广电运通	4,800	57,120.00	0.19
190	000975	银泰黄金	6,500	57,070.00	0.19
191	300244	迪安诊断	1,700	57,069.00	0.19
192	000021	深科技	3,600	57,024.00	0.19

193	002221	东华能源	4,500	56,655.00	0.19
194	600171	上海贝岭	2,200	56,452.00	0.19
195	000513	丽珠集团	1,400	56,294.00	0.19
196	300630	普利制药	1,018	56,030.72	0.19
197	000656	金科股份	12,500	56,000.00	0.19
198	600348	华阳股份	4,700	55,695.00	0.19
199	002572	索菲亚	2,500	55,500.00	0.19
200	600535	天士力	3,500	55,475.00	0.19
201	002500	山西证券	8,400	55,440.00	0.19
202	601005	重庆钢铁	26,300	54,967.00	0.19
203	600536	中国软件	1,100	54,923.00	0.19
204	300026	红日药业	7,000	54,810.00	0.19
205	300024	机器人	4,900	54,733.00	0.19
206	603156	养元饮品	1,900	53,979.00	0.18
207	300212	易华录	1,520	53,732.00	0.18
208	000878	云南铜业	4,000	53,480.00	0.18
209	002127	南极电商	7,700	53,130.00	0.18
210	600998	九州通	3,600	52,992.00	0.18
211	000970	中科三环	3,300	52,965.00	0.18
212	000012	南玻A	5,300	52,629.00	0.18
213	600315	上海家化	1,300	52,533.00	0.18
214	300315	掌趣科技	10,800	52,488.00	0.18
215	002195	二三四五	22,400	52,416.00	0.18
216	600673	东阳光	5,900	52,392.00	0.18
217	002250	联化科技	2,900	52,113.00	0.18
218	601872	招商轮船	12,700	52,070.00	0.18
219	601699	潞安环能	4,600	52,026.00	0.18
220	603712	七一二	1,200	51,960.00	0.18
221	600415	小商品城	10,700	51,895.00	0.18
222	002745	木林森	3,400	51,442.00	0.17
223	000999	华润三九	1,500	51,360.00	0.17

224	002683	广东宏大	1,700	51,204.00	0.17
225	603568	伟明环保	1,400	51,142.00	0.17
226	002019	亿帆医药	2,900	51,098.00	0.17
227	300182	捷成股份	8,000	50,640.00	0.17
228	000537	广宇发展	2,100	50,610.00	0.17
229	600863	内蒙华电	12,800	50,432.00	0.17
230	601866	中远海发	15,501	50,378.25	0.17
231	000690	宝新能源	8,500	50,320.00	0.17
232	600801	华新水泥	2,600	50,180.00	0.17
233	002511	中顺洁柔	3,000	50,130.00	0.17
234	600208	新潮中宝	16,800	50,064.00	0.17
235	300463	迈克生物	1,700	49,623.00	0.17
236	600970	中材国际	4,300	49,149.00	0.17
237	000060	中金岭南	10,000	49,100.00	0.17
238	002153	石基信息	1,700	48,858.00	0.17
239	600517	国网英大	6,700	48,843.00	0.17
240	000686	东北证券	5,500	48,290.00	0.16
241	600839	四川长虹	14,500	47,995.00	0.16
242	601778	晶科科技	5,600	47,768.00	0.16
243	002505	鹏都农牧	12,500	47,750.00	0.16
244	600380	健康元	3,700	47,508.00	0.16
245	002831	裕同科技	1,400	47,166.00	0.16
246	600390	五矿资本	8,800	46,816.00	0.16
247	600155	华创阳安	4,700	46,812.00	0.16
248	600498	烽火通信	2,600	46,748.00	0.16
249	000930	中粮科技	4,300	46,741.00	0.16
250	002939	长城证券	3,600	46,620.00	0.16
251	000729	燕京啤酒	5,500	46,585.00	0.16
252	002294	信立泰	1,700	46,444.00	0.16
253	603858	步长制药	2,200	46,398.00	0.16
254	601992	金隅集团	16,300	46,292.00	0.16

255	600500	中化国际	5,400	46,224.00	0.16
256	002701	奥瑞金	6,600	46,200.00	0.16
257	600718	东软集团	3,400	46,104.00	0.16
258	300482	万孚生物	1,170	46,074.60	0.16
259	600667	太极实业	5,700	46,056.00	0.16
260	600728	佳都科技	5,500	45,815.00	0.16
261	000401	冀东水泥	3,800	45,448.00	0.15
262	600158	中体产业	3,000	45,360.00	0.15
263	300376	易事特	4,500	45,225.00	0.15
264	600895	张江高科	3,000	45,180.00	0.15
265	002430	杭氧股份	1,500	45,015.00	0.15
266	002004	华邦健康	6,200	44,888.00	0.15
267	600764	中国海防	1,100	44,726.00	0.15
268	603225	新凤鸣	3,000	44,550.00	0.15
268	002128	电投能源	3,000	44,550.00	0.15
270	600216	浙江医药	2,600	44,408.00	0.15
271	601179	中国西电	8,000	44,400.00	0.15
271	600282	南钢股份	12,000	44,400.00	0.15
273	000598	兴蓉环境	7,000	44,240.00	0.15
274	600511	国药股份	1,400	44,142.00	0.15
275	002532	天山铝业	5,400	44,010.00	0.15
276	002966	苏州银行	6,500	44,005.00	0.15
277	002382	蓝帆医疗	2,700	43,983.00	0.15
278	300072	三聚环保	5,500	43,615.00	0.15
279	000540	中天金融	16,500	43,560.00	0.15
280	002670	国盛金控	4,500	43,200.00	0.15
281	688006	杭可科技	400	43,032.00	0.15
282	600528	中铁工业	5,200	42,692.00	0.14
283	002174	游族网络	2,800	42,672.00	0.14
284	600985	淮北矿业	3,800	42,484.00	0.14
285	600297	广汇汽车	15,900	42,453.00	0.14

286	002396	星网锐捷	1,800	42,426.00	0.14
287	603444	吉比特	100	42,185.00	0.14
288	603638	艾迪精密	1,320	42,134.40	0.14
289	002958	青农商行	10,900	42,074.00	0.14
290	603866	桃李面包	1,480	42,032.00	0.14
291	002368	太极股份	1,520	41,860.80	0.14
292	600755	厦门国贸	5,800	41,818.00	0.14
293	600409	三友化工	4,800	41,760.00	0.14
293	002010	传化智联	4,800	41,760.00	0.14
295	601717	郑煤机	3,600	41,724.00	0.14
296	002595	豪迈科技	1,500	41,640.00	0.14
297	002925	盈趣科技	1,220	41,516.60	0.14
298	600567	山鹰国际	12,600	41,454.00	0.14
299	600827	百联股份	3,100	41,323.00	0.14
300	300271	华宇软件	3,241	41,160.70	0.14
301	002048	宁波华翔	1,900	41,097.00	0.14
302	000581	威孚高科	1,900	40,926.00	0.14
303	000709	河钢股份	16,600	40,836.00	0.14
304	603885	吉祥航空	2,300	40,825.00	0.14
305	000778	新兴铸管	9,400	40,702.00	0.14
306	002183	怡亚通	6,100	40,382.00	0.14
307	600060	海信视像	3,000	40,350.00	0.14
308	002075	沙钢股份	6,900	40,227.00	0.14
309	000883	湖北能源	7,600	39,824.00	0.14
310	600820	隧道股份	7,400	39,812.00	0.14
311	600325	华发股份	6,600	39,732.00	0.13
312	600782	新钢股份	7,500	39,600.00	0.13
313	600507	方大特钢	5,067	39,522.60	0.13
314	600737	中粮糖业	4,200	39,480.00	0.13
315	600967	内蒙一机	3,300	39,435.00	0.13
316	600131	国网信通	1,800	39,330.00	0.13

317	600598	北大荒	2,700	39,312.00	0.13
318	600597	光明乳业	2,700	39,204.00	0.13
319	601456	国联证券	2,800	39,116.00	0.13
320	002690	美亚光电	1,028	38,508.88	0.13
321	600021	上海电力	3,000	38,460.00	0.13
322	002434	万里扬	2,600	38,324.00	0.13
323	600022	山东钢铁	21,400	38,306.00	0.13
324	601880	辽港股份	22,100	38,233.00	0.13
325	600707	彩虹股份	5,600	38,192.00	0.13
326	000990	诚志股份	2,400	37,968.00	0.13
327	000987	越秀金控	4,300	37,410.00	0.13
328	600435	北方导航	3,500	37,380.00	0.13
329	002281	光迅科技	1,600	37,264.00	0.13
330	601106	中国一重	10,700	37,236.00	0.13
331	002146	荣盛发展	8,500	36,975.00	0.13
332	600663	陆家嘴	3,400	36,924.00	0.13
333	600566	济川药业	1,300	36,842.00	0.13
334	601577	长沙银行	4,700	36,707.00	0.12
335	603927	中科软	1,340	36,662.40	0.12
336	002124	天邦股份	5,680	36,579.20	0.12
337	603883	老百姓	740	36,541.20	0.12
338	600572	康恩贝	7,300	36,500.00	0.12
339	600446	金证股份	2,500	35,800.00	0.12
340	601118	海南橡胶	6,700	35,376.00	0.12
341	000898	鞍钢股份	9,400	35,250.00	0.12
342	603650	彤程新材	700	35,224.00	0.12
343	600811	东方集团	11,600	34,916.00	0.12
344	002390	信邦制药	4,700	34,874.00	0.12
345	000488	晨鸣纸业	4,800	34,752.00	0.12
346	002233	塔牌集团	3,273	34,628.34	0.12
347	600329	中新药业	1,100	34,551.00	0.12

348	002440	闰土股份	3,600	34,524.00	0.12
349	002429	兆驰股份	7,100	34,506.00	0.12
350	600259	广晟有色	700	34,468.00	0.12
351	600808	马钢股份	9,300	34,317.00	0.12
352	002155	湖南黄金	3,300	34,188.00	0.12
353	000877	天山股份	2,200	33,682.00	0.11
354	300166	东方国信	3,100	33,480.00	0.11
355	002416	爱施德	2,900	33,002.00	0.11
356	600037	歌华有线	3,800	32,984.00	0.11
357	002085	万丰奥威	6,000	32,940.00	0.11
358	600908	无锡银行	5,800	32,886.00	0.11
359	601200	上海环境	2,600	32,734.00	0.11
360	002110	三钢闽光	4,800	32,640.00	0.11
361	000559	万向钱潮	5,100	32,487.00	0.11
362	603228	景旺电子	940	32,458.20	0.11
363	001914	招商积余	1,600	32,416.00	0.11
364	600373	中文传媒	2,600	32,136.00	0.11
365	600398	海澜之家	5,000	32,050.00	0.11
366	601000	唐山港	11,600	31,900.00	0.11
366	600906	财达证券	2,500	31,900.00	0.11
368	600026	中远海能	5,374	31,814.08	0.11
369	002081	金螳螂	5,200	31,616.00	0.11
370	600167	联美控股	3,500	31,535.00	0.11
371	688321	微芯生物	900	31,509.00	0.11
372	601991	大唐发电	9,700	31,428.00	0.11
373	600546	山煤国际	3,800	31,198.00	0.11
374	000961	中南建设	7,500	31,050.00	0.11
375	601611	中国核建	3,100	30,907.00	0.10
376	688088	虹软科技	700	30,842.00	0.10
377	000528	柳工	4,000	30,840.00	0.10
378	600064	南京高科	3,300	30,822.00	0.10

379	601718	际华集团	10,300	30,694.00	0.10
380	600195	中牧股份	2,332	30,479.24	0.10
381	601608	中信重工	6,800	30,328.00	0.10
382	603000	人民网	2,100	30,282.00	0.10
383	002038	双鹭药业	2,800	30,268.00	0.10
384	000685	中山公用	3,400	30,090.00	0.10
385	000090	天健集团	5,100	29,937.00	0.10
386	600120	浙江东方	6,760	29,879.20	0.10
387	000959	首钢股份	5,200	29,796.00	0.10
388	601333	广深铁路	13,300	29,792.00	0.10
389	300133	华策影视	4,400	29,788.00	0.10
390	000158	常山北明	4,300	29,756.00	0.10
391	002387	维信诺	3,200	29,696.00	0.10
392	002705	新宝股份	1,200	29,640.00	0.10
393	000758	中色股份	5,400	29,484.00	0.10
394	002867	周大生	1,650	29,337.00	0.10
395	000671	阳光城	9,700	29,294.00	0.10
396	000089	深圳机场	4,000	29,280.00	0.10
397	600582	天地科技	6,500	28,470.00	0.10
398	600376	首开股份	5,000	28,300.00	0.10
399	000415	渤海租赁	9,700	28,227.00	0.10
400	002242	九阳股份	1,200	27,840.00	0.09
401	000718	苏宁环球	5,900	27,789.00	0.09
402	601598	中国外运	6,100	27,328.00	0.09
403	600126	杭钢股份	5,300	27,189.00	0.09
404	601975	招商南油	13,500	27,135.00	0.09
405	000967	盈峰环境	3,700	27,121.00	0.09
406	600307	酒钢宏兴	12,300	27,060.00	0.09
407	601098	中南传媒	2,800	26,796.00	0.09
408	600062	华润双鹤	2,000	26,740.00	0.09
409	000402	金融街	4,600	26,036.00	0.09

410	601958	金钼股份	3,800	26,030.00	0.09
411	002458	益生股份	2,300	26,013.00	0.09
412	600556	天下秀	2,100	25,935.00	0.09
413	600643	爱建集团	3,800	25,688.00	0.09
414	600959	江苏有线	7,800	25,662.00	0.09
415	003022	联泓新科	700	25,508.00	0.09
416	001965	招商公路	3,300	25,311.00	0.09
417	000563	陕国投 A	7,740	25,000.20	0.08
418	600032	浙江新能	1,563	24,163.98	0.08
419	003035	南网能源	2,900	24,041.00	0.08
420	002563	森马服饰	3,100	23,963.00	0.08
421	002399	海普瑞	1,400	23,940.00	0.08
422	300257	开山股份	1,500	23,820.00	0.08
423	601860	紫金银行	7,100	23,785.00	0.08
424	600056	中国医药	2,000	23,620.00	0.08
425	688289	圣湘生物	400	23,600.00	0.08
426	600266	城建发展	5,220	23,490.00	0.08
427	600717	天津港	5,604	23,480.76	0.08
428	601928	凤凰传媒	2,900	23,461.00	0.08
429	600901	江苏租赁	4,600	23,414.00	0.08
430	600968	海油发展	7,900	23,147.00	0.08
431	603317	天味食品	848	22,734.88	0.08
432	000937	冀中能源	4,100	22,591.00	0.08
433	002244	滨江集团	4,800	22,368.00	0.08
434	600928	西安银行	5,200	22,360.00	0.08
435	000717	韶钢松山	4,700	22,325.00	0.08
436	600095	湘财股份	2,200	22,264.00	0.08
437	002815	崇达技术	1,300	21,905.00	0.07
438	002423	中粮资本	2,700	21,870.00	0.07
439	002468	申通快递	2,400	21,816.00	0.07
440	688029	南微医学	100	21,267.00	0.07

441	600787	中储股份	3,400	21,216.00	0.07
442	600006	东风汽车	3,100	21,111.00	0.07
443	600776	东方通信	1,800	20,718.00	0.07
444	000062	深圳华强	1,200	20,676.00	0.07
445	002424	贵州百灵	2,700	20,520.00	0.07
446	600649	城投控股	4,900	20,139.00	0.07
447	600623	华谊集团	2,200	20,020.00	0.07
447	600339	中油工程	6,500	20,020.00	0.07
449	002375	亚厦股份	2,600	19,474.00	0.07
450	601139	深圳燃气	2,200	19,426.00	0.07
451	300741	华宝股份	400	19,140.00	0.06
452	600835	上海机电	1,200	19,104.00	0.06
453	000031	大悦城	5,000	18,650.00	0.06
454	600648	外高桥	1,400	18,522.00	0.06
455	000028	国药一致	500	18,490.00	0.06
456	600299	安迪苏	1,500	18,480.00	0.06
457	600729	重庆百货	700	18,214.00	0.06
458	601969	海南矿业	1,500	18,015.00	0.06
459	000156	华数传媒	2,100	17,766.00	0.06
460	600871	石化油服	7,900	16,906.00	0.06
461	600639	浦东金桥	1,300	16,601.00	0.06
462	600377	宁沪高速	1,900	16,378.00	0.06
463	002653	海思科	800	16,320.00	0.06
464	300869	康泰医学	400	16,220.00	0.06
465	601228	广州港	4,800	15,984.00	0.05
466	000869	张裕 A	500	15,930.00	0.05
467	601828	美凯龙	1,800	15,858.00	0.05
468	601298	青岛港	2,700	15,363.00	0.05
469	002302	西部建设	1,900	15,257.00	0.05
470	000046	泛海控股	8,100	15,228.00	0.05
471	603379	三美股份	660	15,034.80	0.05

472	603708	家家悦	900	14,976.00	0.05
473	002948	青岛银行	3,200	14,816.00	0.05
474	600823	世茂股份	4,400	14,432.00	0.05
475	000553	安道麦A	1,700	14,348.00	0.05
476	002945	华林证券	1,000	13,660.00	0.05
477	001872	招商港口	800	13,560.00	0.05
478	601156	东航物流	600	13,128.00	0.04
479	601869	长飞光纤	400	13,096.00	0.04
480	603719	良品铺子	300	12,741.00	0.04
481	600350	山东高速	2,400	12,384.00	0.04
482	603355	莱克电气	420	12,314.40	0.04
483	600657	信达地产	3,300	12,309.00	0.04
484	603056	德邦股份	1,200	12,276.00	0.04
485	601568	北元集团	1,500	12,195.00	0.04
486	001203	大中矿业	800	12,064.00	0.04
487	600466	蓝光发展	5,900	12,036.00	0.04
488	601665	齐鲁银行	1,900	10,602.00	0.04
489	601003	柳钢股份	2,000	10,440.00	0.04
490	603515	欧普照明	500	10,380.00	0.04
491	600917	重庆燃气	1,200	10,068.00	0.03
492	002946	新乳业	600	9,564.00	0.03
493	600956	新天绿能	500	8,605.00	0.03
494	603786	科博达	100	8,030.00	0.03
495	600903	贵州燃气	800	7,744.00	0.03
496	601187	厦门银行	1,100	7,590.00	0.03
497	603983	丸美股份	200	6,374.00	0.02
498	002901	大博医疗	100	5,062.00	0.02
499	603868	飞科电器	100	4,342.00	0.01
500	001234	泰慕士	138	2,281.14	0.01

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	003035	南网能源	1,229,025.80	2.70
2	003022	联泓新科	1,065,657.00	2.34
3	603719	良品铺子	770,402.00	1.69
4	000799	酒鬼酒	287,814.00	0.63
5	600068	葛洲坝	276,540.00	0.61
6	002709	天赐材料	205,332.00	0.45
7	603290	斯达半导	201,796.00	0.44
8	600522	中天科技	185,876.00	0.41
9	603444	吉比特	180,313.00	0.40
10	600157	永泰能源	169,287.00	0.37
11	605358	立昂微	167,732.00	0.37
12	601555	东吴证券	165,845.00	0.36
13	300253	卫宁健康	163,226.00	0.36
14	000733	振华科技	155,648.00	0.34
15	300037	新宙邦	154,410.00	0.34
16	601636	旗滨集团	152,321.00	0.33
17	600399	抚顺特钢	143,919.00	0.32
18	601868	中国能建	142,496.00	0.31
19	002340	格林美	142,415.50	0.31
20	300308	中际旭创	142,309.00	0.31

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

### 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	003022	联泓新科	1,265,357.00	2.78
2	003035	南网能源	1,121,009.19	2.46
3	603719	良品铺子	838,391.41	1.84
4	300274	阳光电源	820,245.95	1.80
5	002709	天赐材料	619,475.50	1.36
6	002074	国轩高科	500,122.00	1.10
7	600089	特变电工	434,534.00	0.95
8	300012	华测检测	431,127.56	0.95
9	300207	欣旺达	402,814.00	0.88
10	300316	晶盛机电	338,444.00	0.74
11	300496	中科创达	316,609.00	0.69
12	300595	欧普康视	303,962.40	0.67
13	000799	酒鬼酒	286,260.00	0.63
14	600068	葛洲坝	281,208.00	0.62
15	603444	吉比特	269,446.00	0.59
16	002568	百润股份	262,240.00	0.58
17	002625	光启技术	260,469.00	0.57
18	600460	士兰微	255,769.00	0.56
19	600426	华鲁恒升	243,476.00	0.53
20	300285	国瓷材料	239,062.00	0.52

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

#### 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	26,792,503.10
卖出股票收入（成交）总额	36,450,454.57

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	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)	9,406.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,406.40	0.03

## 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	110083	苏租转债	80	9,406.40	0.03

## 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

注：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

注：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

注：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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值 变动	风险说明
----	----	--------------	------	------------	------

IC2203	中证500股指期货2203合约	1	1,461,160.00	43,680.00	本报告期内,本基金投资股指期货根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,进行多头套期保值操作。
公允价值变动总额合计(元)					43,680.00
股指期货投资本期收益(元)					412,194.17
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-6,280.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,目的在于满足基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注: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 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,或者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过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	208,120.36
2	应收证券清算款	31,924.11
3	应收股利	-

4	应收利息	701.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	240,746.01

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

##### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 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，各比例的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

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		中融中证500交易型 开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
315	61,41 4.92	2,000.00	0.01%	5,166,500.00	26.71%	14,177,20 0.00	73.28%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈建仁	1,838,300.00	9.50%
2	王道顺	500,000.00	2.58%
3	李园园	333,400.00	1.72%
4	成志开	200,800.00	1.04%
5	钱中明	175,400.00	0.91%
6	朱军	138,000.00	0.71%
7	张瑞娟	120,200.00	0.62%
8	李素萍	100,000.00	0.52%
9	陈建慧	100,000.00	0.52%
10	华乔	74,000.00	0.38%
-	中国光大银行股份有限公司—中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	14,177,200.00	73.28%

注：前十名持有人为除中融中证500ETF联接基金之外的前十名持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 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

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月15日)基金份额总额	235,345,700.00
本报告期期初基金份额总额	35,345,700.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,345,700.00

## § 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2021年6月19日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁罗杰先生离任。

本基金管理人于2021年8月28日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁田刚先生离任。

公司其他高管人员未变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续2年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为20,000.00元人民币。

### 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	佣金	占当期佣	

			票成交总 额的比例		金总量的 比例	
渤海证券	2	24,229,560.05	38.67%	17,720.92	38.67%	-
广发证券	2	38,430,510.92	61.33%	28,101.85	61.33%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 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
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	8,334.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
2	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06

3	中融基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-27
4	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-17
5	中融基金管理有限公司关于旗下部分公募基金增加侧袋机制并根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修订基金合同部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
6	中融基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
7	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
8	中融基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“中融基金”名义进行诈骗活动的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
9	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-14
10	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
11	中融基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-28
12	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-26
13	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-18

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20210101-20211231	28,874,000.00	640,000.00	15,336,800.00	14,177,200.00	73.28%

#### 产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (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
- (6) 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

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

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日