

# 中加中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信建投证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 27 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026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。

本报告期自2025年01月01日起至2025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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	14
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 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	83
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	83
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	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	83

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	83
8.12 投资组合报告附注 .....	83
§9 基金份额持有人信息 .....	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	85
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 .....	85
§10 开放式基金份额变动 .....	85
§11 重大事件揭示 .....	86
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	86
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 .....	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	86
11.4 基金投资策略的改变 .....	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	87
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	87
11.8 其他重大事件 .....	88
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
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 .....	90
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
§13 备查文件目录 .....	91
13.1 备查文件目录 .....	91
13.2 存放地点 .....	91
13.3 查阅方式 .....	91

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中加中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中加中证500指数增强	
基金主代码	010153	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年09月27日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,789,033.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加中证500指数增强 A	中加中证500指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010153	010154
报告期末下属分级基金的份额总额	8,576,460.06份	17,212,573.56份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
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，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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	中加基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌
	联系电话	400-00-95526
	电子邮箱	service@bobbns.com
客户服务电话	400-00-95526	95587
传真	010-83197627	010-56162085
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市朝阳区景辉街16号院1号楼泰康集团大厦8层/18层，北京市朝阳区光华路10号院中信大厦82层
邮政编码	100050	100020
法定代表人	杨琳	刘成

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区南纬路35号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35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	2025年		2024年		2023年	
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C
本期已实现收益	2,944,392.19	4,220,612.41	1,178,162.94	1,875,341.50	-491,518.12	-3,322,326.23
本期利润	3,281,978.47	5,131,845.17	818,961.03	1,900,379.49	588,479.90	-2,407,475.03
加权平均基金份额本期利润	0.2852	0.2778	0.0623	0.0931	0.0236	-0.0495
本期加权平均净值利润率	27.00%	26.46%	7.15%	10.84%	2.50%	-5.29%
本期基金份额净值增长率	32.94%	32.54%	8.82%	8.51%	-5.99%	-6.26%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	2,168,336.03	4,014,921.60	-674,248.07	-1,485,726.37	-1,796,874.25	-2,263,917.19
期末可供分配基金份额利润	0.2528	0.2333	-0.0492	-0.0615	-0.1263	-0.1351
期末基金资产净值	10,841,053.34	21,410,370.82	13,041,611.55	22,672,912.31	12,426,749.39	14,489,359.23
期末基金份额净值	1.2640	1.2439	0.9508	0.9385	0.8737	0.8649
3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	26.40%	24.39%	-4.92%	-6.15%	-12.63%	-13.51%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

### 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

中加中证500指数增强A

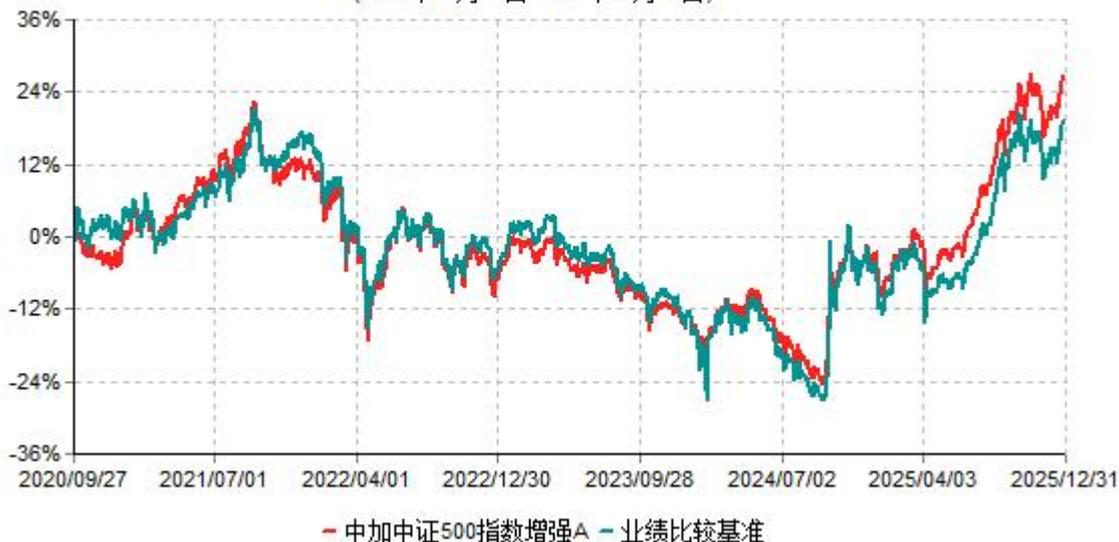
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.83%	1.05%	0.71%	1.18%	2.12%	-0.13%
过去六个月	25.02%	0.99%	24.81%	1.11%	0.21%	-0.12%
过去一年	32.94%	1.08%	28.81%	1.20%	4.13%	-0.12%
过去三年	36.00%	1.18%	26.25%	1.30%	9.75%	-0.12%
过去五年	28.65%	1.16%	16.99%	1.23%	11.66%	-0.07%
自基金合同生效起至今	26.40%	1.15%	19.34%	1.23%	7.06%	-0.08%

中加中证500指数增强C

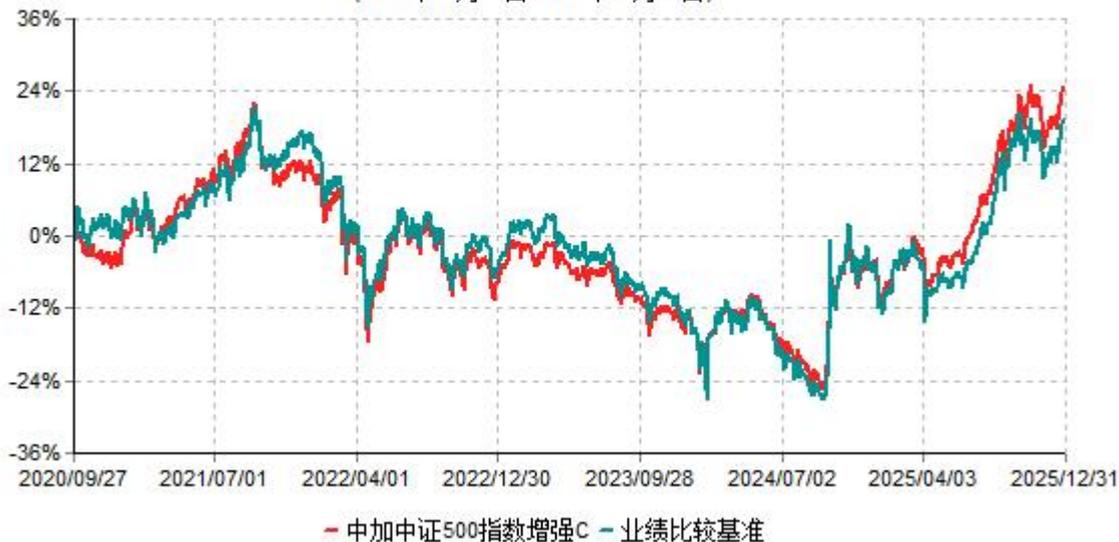
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.76%	1.05%	0.71%	1.18%	2.05%	-0.13%
过去六个月	24.84%	0.99%	24.81%	1.11%	0.03%	-0.12%
过去一年	32.54%	1.08%	28.81%	1.20%	3.73%	-0.12%
过去三年	34.81%	1.18%	26.25%	1.30%	8.56%	-0.12%
过去五年	26.73%	1.16%	16.99%	1.23%	9.74%	-0.07%
自基金合同生效起至今	24.39%	1.15%	19.34%	1.23%	5.05%	-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

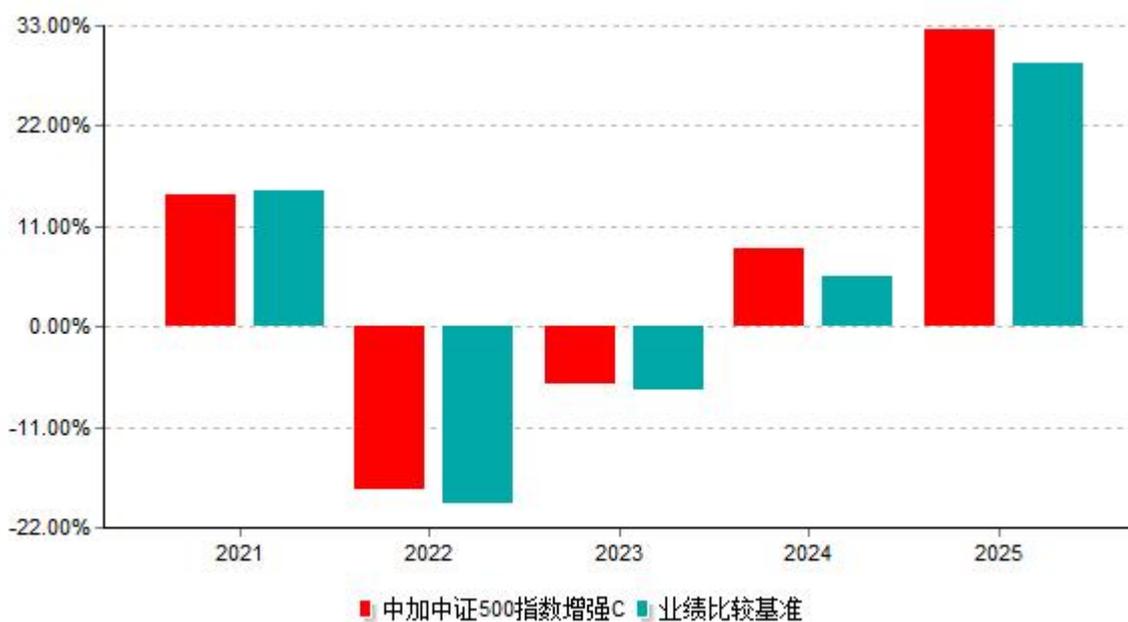
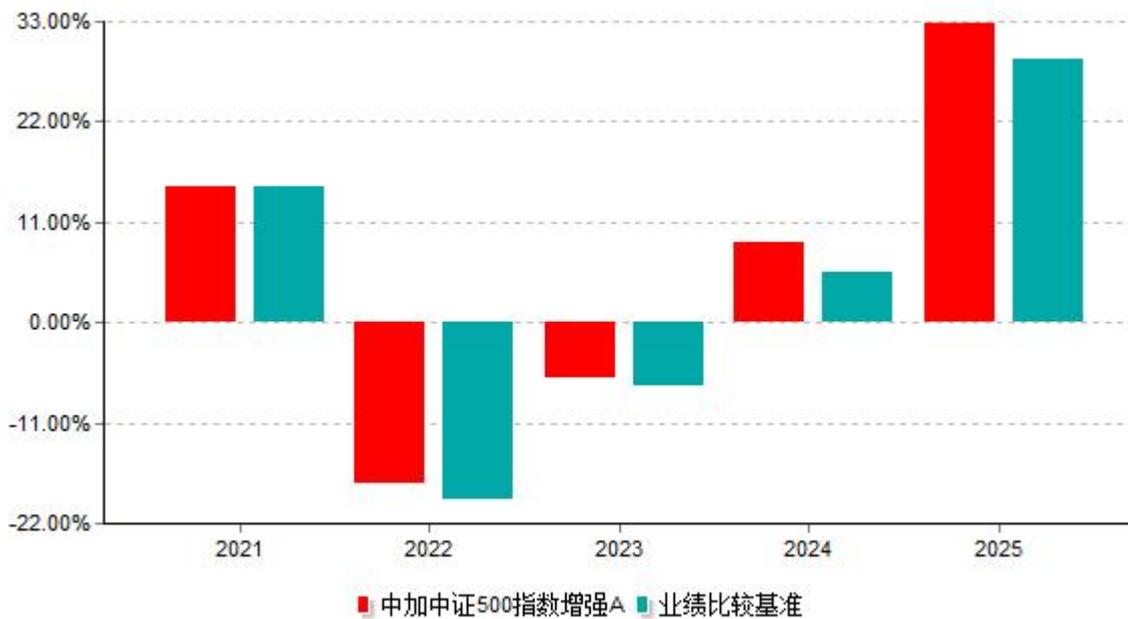
中加中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年09月27日-2025年12月31日)



中加中证500指数增强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09月27日-2025年12月31日)



### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在过去三年未实施利润分配。

## §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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

截至报告期末，本基金管理人共管理76只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

#### 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		
钟伟	本基金基金经理	2020-09-27	-	16	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021

					年8月13日至今)、中加量化研选混合型证券投资基金(2022年4月11日至今)、中加科丰价值精选混合型证券投资基金(2023年2月15日至今)、中加聚享增盈债券型证券投资基金(2023年7月13日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4、本基金无基金经理助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

#### 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

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

#### 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

2025年，A股市场以11连阳收尾，为全年的结构性牛市画上了完美的句号。

今年1月份，A股市场开年调整。春节以后，DeepSeek概念持续发酵，在人工智能、科技和传媒板块的带动下，A股走出一波如火如荼的上涨行情。3月中旬以后，由于关税政策的担忧，市场转为震荡下行。

4月初，由于中美之间贸易摩擦升级，全球股市大跌，A股市场短期快速下跌。之后，中央汇金借道ETF入市，保险资金也同步入市，稳定投资者信心，A股止跌反弹。5月初，央行、金融监管总局和证监会发布了包括降准降息等“一揽子稳市场稳预期”的政策支持，中美之间开展贸易谈判，贸易摩擦逐步降温，中东地缘冲突也以停火的方式结束。在利好因素的影响下，A股在触底后逐渐走出震荡上行的走势。

三季度国内流动性处于较为宽裕的阶段，A股市场迎来一波快速的上涨。7月份以来，在“反内卷”政策的催化以及美联储降息的预期下，市场走出一波持续上涨的行情。8月份下旬，通讯、电子等板块个股由于业绩预期增速较高，进一步提振市场信心，带领市场进一步上行。市场成交量也不断创出新高，交投情绪高涨。

四季度A股进入震荡盘整期。国内方面，经济数据偏弱。中国制造业PMI指数持续位于枯荣线以下，规模以上工业企业利润当月同比增速由正转负，社零同比增速也开始下滑。海外方面，中美之间的贸易摩擦重启与缓和，海外对科技巨头“循环投资”的模式担忧增加了市场对AI前景的分歧。市场在震荡盘整中前行。12月中央经济工作会议之后，日本央行加息落地，市场风险偏好上升，沪指年底走出11连阳的走势。

本报告期，沪深300指数上涨17.66%，中证500和中证1000指数分别上涨30.39%和27.49%。小市值风格表现占优。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。报告期内，基金保持仓位稳定，在严格控制跟踪误差的基础上，力争获得持续稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证500指数增强A基金份额净值为1.2640元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为32.94%，同期业绩比较基准收益率为28.81%；截至报告期末中加中证500指数增强C基金份额净值为1.2439元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为32.54%，同期业绩比较基准收益率为28.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年12月中央经济工作会议明确提出要继续实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，市场流动性有望继续保持宽松。今年经济增长的动能更多依赖内需的边际改善，扩大内需是今年的重点任务和政策发力的方向。中美贸易摩擦阶段性缓和，有利于出口方面继续保持韧性。A股市场上涨的驱动力将逐步从流动性驱动转向盈利驱动。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、法律合规与内控部及审计部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司法律合规与内控部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响，以及对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金2025年度未进行本期利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，发生连续六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元的情形，本基金管理人已将相关解决方案上报中国证监会。

本报告期内，本基金迷你期间的信息披露费、审计费等固定费用由基金管理人承担。

## §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，中信建投证券股份有限公司在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和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。截至2025年12月31日，本基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2603593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	中加中证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	我们审计了后附的中加中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营

	成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人中加基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,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

	<p>报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该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>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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</p>

	<p>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该基金不能持续经营。</p> <p>(5)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>我们与该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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	楼竹君
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层	
审计报告日期	2026-03-26	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,031,284.04	2,380,055.54
结算备付金		1,056.12	1,040.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	30,467,228.85	33,843,504.27
其中：股票投资		30,467,228.85	33,843,504.27
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	199,986.65
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,135.25	209,590.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		32,509,704.26	36,634,178.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		222,802.81	821,994.03
应付管理人报酬		24,449.70	24,140.39
应付托管费		4,584.31	4,526.33
应付销售服务费		6,336.38	5,592.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	106.85	63,400.93
负债合计		258,280.10	919,654.36

<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	25,789,033.62	37,874,498.30
未分配利润	7.4.7.8	6,462,390.54	-2,159,974.44
净资产合计		32,251,424.16	35,714,523.86
负债和净资产总计		32,509,704.26	36,634,178.22

注：报告截止日2025年12月31日，A类基金份额净值为1.2640元，A类基金份额总额8,576,460.06份；C类基金份额净值为1.2439元，C类基金份额总额17,212,573.56份，总份额合计25,789,033.62份。

## 7.2 利润表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至2 025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2 024年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		8,815,766.82	3,284,224.20
1.利息收入		14,664.93	17,080.84
其中：存款利息收入	7.4.7.9	11,784.46	10,867.09
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		2,880.47	6,213.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		7,372,826.43	3,463,926.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	6,824,031.06	2,909,346.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	688.11	464.36
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	548,107.26	554,115.74
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,248,819.04	-334,163.92
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	179,456.42	137,380.63
<b>减：二、营业总支出</b>		401,943.18	564,883.68
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	252,555.09	231,667.00
2.托管费	7.4.10.2.2	47,354.05	43,437.59
3.销售服务费	7.4.10.2.3	58,145.14	52,483.28
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		0.01	-
8.其他费用	7.4.7.19	43,888.89	237,295.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,413,823.64	2,719,340.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,413,823.64	2,719,340.52
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		8,413,823.64	2,719,340.52

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中加中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,874,498.30	-2,159,974.44	35,714,523.86
二、本期期初净资产	37,874,498.30	-2,159,974.44	35,714,523.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,085,464.68	8,622,364.98	-3,463,099.70
（一）、综合收益总额	-	8,413,823.64	8,413,823.64
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,085,464.68	208,541.34	-11,876,923.34
其中：1.基金申购款	53,205,454.28	6,706,550.56	59,912,004.84
2.基金赎回款	-65,290,918.96	-6,498,009.22	-71,788,928.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	25,789,033.62	6,462,390.54	32,251,424.16
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,976,900.06	-4,060,791.44	26,916,108.62

产			
二、本期期初净资产	30,976,900.06	-4,060,791.44	26,916,108.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,897,598.24	1,900,817.00	8,798,415.24
（一）、综合收益总额	-	2,719,340.52	2,719,340.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,897,598.24	-818,523.52	6,079,074.72
其中：1.基金申购款	64,082,361.24	-7,545,164.51	56,537,196.73
2.基金赎回款	-57,184,763.00	6,726,640.99	-50,458,122.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	37,874,498.30	-2,159,974.44	35,714,523.86

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：

杨琳

于春玲

于春玲

-----

-----

-----

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

中加中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2020年8月25日证监许可[2020]1946号文注册，由中

加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投证券”)。

本基金通过中加基金直销中心公开发售,募集期为2020年9月14日起至2020年9月23日止。本基金于2020年9月27日成立,成立之日基金实收份额为204,983,003.67份(含利息转份额8,598.59份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资范围主要为标的指数成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)。此外,为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还包括国内依法发行上市的其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

#### 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

##### (1) 金融工具的初始确认

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

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

## (2)金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

## (3)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

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

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或部分金融负债)。

## (4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的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；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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。

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。

(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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	954,756.86	1,507,427.33
等于：本金	954,430.25	1,507,079.87
加：应计利息	326.61	347.46
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	1,076,527.18	872,628.21
等于：本金	1,076,441.35	872,571.75
加：应计利息	85.83	56.46
合计	2,031,284.04	2,380,055.54

注：其他存款为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		29,709,605.20	-	30,467,228.85	757,623.65
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		29,709,605.20	-	30,467,228.85	757,623.65
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		34,334,699.66	-	33,843,504.27	-491,195.39
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		34,334,699.66	-	33,843,504.27	-491,195.39

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	199,986.65	-
银行间市场	-	-
合计	199,986.65	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	106.85	968.51
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	-	12,432.42
其他应付	-	50,000.00
合计	106.85	63,400.93

注：其他应付款为应付指数使用费。

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 中加中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,715,859.62	13,715,859.62
本期申购	12,496,889.18	12,496,889.18
本期赎回（以“-”号填列）	-17,636,288.74	-17,636,288.74
本期末	8,576,460.06	8,576,460.06

##### 7.4.7.7.2 中加中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,158,638.68	24,158,638.68
本期申购	40,708,565.10	40,708,565.10
本期赎回（以“-”号填列）	-47,654,630.22	-47,654,630.22
本期末	17,212,573.56	17,212,573.56

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中加中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-297,926.69	-376,321.38	-674,248.07
本期期初	-297,926.69	-376,321.38	-674,248.07
本期利润	2,944,392.19	337,586.28	3,281,978.47
本期基金份额交易产生的变动数	-478,129.47	134,992.35	-343,137.12
其中：基金申购款	1,335,444.43	380,173.40	1,715,617.83
基金赎回款	-1,813,573.90	-245,181.05	-2,058,754.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,168,336.03	96,257.25	2,264,593.28

## 7.4.7.8.2 中加中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中加中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-821,505.57	-664,220.80	-1,485,726.37
本期期初	-821,505.57	-664,220.80	-1,485,726.37
本期利润	4,220,612.41	911,232.76	5,131,845.17
本期基金份额交易产生的变动数	615,814.76	-64,136.30	551,678.46
其中：基金申购款	4,661,740.43	329,192.30	4,990,932.73
基金赎回款	-4,045,925.67	-393,328.60	-4,439,254.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,014,921.60	182,875.66	4,197,797.26

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2025年01月01日至2025年 12月31日	2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	8,658.63	8,380.19
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	3,110.54	2,468.08
结算备付金利息收入	15.29	18.82
其他	-	-
合计	11,784.46	10,867.09

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入，其他为申购款利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	336,771,381.58	311,311,636.69
减：卖出股票成本总额	329,603,059.75	307,988,445.54
减：交易费用	344,290.77	413,844.60
买卖股票差价收入	6,824,031.06	2,909,346.55

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
债券投资收益——利息收入	0.14	0.35
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	687.97	464.01
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	688.11	464.36

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,188.20	3,464.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,500.00	3,000.00
减：应计利息总额	0.14	0.55
减：交易费用	0.09	0.14
买卖债券差价收入	687.97	464.01

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益--其他投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
股票投资产生的股利收益	548,107.26	554,115.74
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	548,107.26	554,115.74

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	1,248,819.04	-334,163.92
——股票投资	1,248,819.04	-334,163.92
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——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	1,248,819.04	-334,163.92
----	--------------	-------------

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
基金赎回费收入	175,031.03	130,990.39
转换费收入	4,425.39	6,390.24
合计	179,456.42	137,380.63

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	-	12,432.42
信息披露费	-	24,863.39
证券出借违约金	-	-
指数使用费	43,888.89	200,000.00
合计	43,888.89	237,295.81

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

## 7.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
The Bank of Nova Scotia	基金管理人股东
中国有研科技集团有限公司	基金管理人股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人股东
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
北银国际资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

以下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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中信建投 证券	661,724,662.89	100.00%	628,065,240.85	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
中信建投 证券	2,188.20	100.00%	3,464.70	100.00%

## 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
中信建投 证券	40,910,000.00	100.00%	64,900,000.00	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 2025年01月01日至2025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
中信建投	133,462.37	100.00%	-	-

证券				
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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
中信建投证券	217,828.03	100.00%	-	-

注：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。

#### 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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	252,555.09	231,667.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	116,143.79	95,257.52
应支付基金管理人的净管理费	136,411.30	136,409.48

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	47,354.05	43,437.59

注：支付基金托管人中信建投证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	合计
中加基金管理有限公司	-	184.15	184.15
北京银行股份有限公司	-	10,507.97	10,507.97
中信建投证券股份有限公司	-	23,939.67	23,939.67
合计	-	34,631.79	34,631.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C	合计
中加基金管理有限公司	-	296.55	296.55
北京银行股份有限公司	-	4,742.18	4,742.18
中信建投证券股份有限公司	-	31,622.84	31,622.84

合计	-	36,661.57	36,661.57
----	---	-----------	-----------

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：C类基金份额销售服务费=前一日C类份额基金资产净值×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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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
中信建投 证券-托管	954,756.86	8,658.63	1,507,427.33	8,380.19

户				
中信建投 证券-证券 资金户	1,076,527.18	3,110.54	872,628.21	2,468.08

注：1、本基金托管户的银行存款由基金托管人中信建投证券股份有限公司存放在交通银行北京三里河支行，按银行活期利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于中信建投证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率及规则计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2025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

于2025年12月31日，本基金未有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 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
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	700	52,999.10	55,167.00	-

### 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

截至本报告期末2025年12月31日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31日止，基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2025年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、法律合规与内控部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；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。

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。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）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，除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（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，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 2025年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	2,031,284.04	-	-	-	2,031,284.04
结算备 付金	1,056.12	-	-	-	1,056.12

交易性金融资产	-	-	-	30,467,228.85	30,467,228.85
应收申购款	-	-	-	10,135.25	10,135.25
资产总计	2,032,340.16	-	-	30,477,364.10	32,509,704.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	222,802.81	222,802.81
应付管理人报酬	-	-	-	24,449.70	24,449.70
应付托管费	-	-	-	4,584.31	4,584.31
应付销售服务费	-	-	-	6,336.38	6,336.38
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	106.85	106.85
负债总计	-	-	-	258,280.10	258,280.10
利率敏感度缺口	2,032,340.16	-	-	30,219,084.00	32,251,424.16
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,380,055.54	-	-	-	2,380,055.54
结算备付金	1,040.83	-	-	-	1,040.83

交易性金融资产	-	-	-	33,843,504.27	33,843,504.27
买入返售金融资产	199,986.65	-	-	-	199,986.65
应收申购款	-	-	-	209,590.93	209,590.93
资产总计	2,581,083.02	-	-	34,053,095.20	36,634,178.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	821,994.03	821,994.03
应付管理人报酬	-	-	-	24,140.39	24,140.39
应付托管费	-	-	-	4,526.33	4,526.33
应付销售服务费	-	-	-	5,592.68	5,592.68
其他负债	-	-	-	63,400.93	63,400.93
负债总计	-	-	-	919,654.36	919,654.36
利率敏感度缺口	2,581,083.02	-	-	33,133,440.84	35,714,523.86

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

本基金于本报告期末及上期末未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此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，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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以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 2025年12月31日		上年度末 2024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	30,467,228.85	94.47	33,843,504.27	94.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,467,228.85	94.47	33,843,504.27	94.76

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,453,128.64	1,615,876.18
	业绩比较基准下降5%	-1,453,128.64	-1,615,876.18

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	30,412,061.85	33,787,910.27
第二层次	55,167.00	55,594.00
第三层次	-	-
合计	30,467,228.85	33,843,504.27

###### 7.4.14.2.2 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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交

易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度期末：无）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	30,467,228.85	93.72
	其中：股票	30,467,228.85	93.72
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	2,032,340.16	6.25
8	其他各项资产	10,135.25	0.03

9	合计	32,509,704.26	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	8,190.00	0.03
B	采矿业	1,826,100.00	5.66
C	制造业	17,542,414.71	54.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	769,914.00	2.39
E	建筑业	201,310.00	0.62
F	批发和零售业	1,228,159.92	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	328,591.00	1.02
H	住宿和餐饮业	68,229.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,204,040.62	6.83
J	金融业	2,138,152.00	6.63
K	房地产业	193,773.00	0.60
L	租赁和商务服务业	98,989.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	130,839.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	57,545.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	20,271.00	0.06
S	综合	94,206.00	0.29
	合计	26,910,724.25	83.44

### 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	16,604.00	0.05
B	采矿业	314,344.00	0.97
C	制造业	2,332,339.60	7.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	129,882.00	0.40
E	建筑业	43,091.00	0.13
F	批发和零售业	81,039.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	363.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	266,621.00	0.83
J	金融业	91,886.00	0.28
K	房地产业	47,835.00	0.15
L	租赁和商务服务业	75,072.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	100,561.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	46,617.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,250.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,556,504.60	11.03

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	300073	当升科技	11,200	647,360.00	2.01
2	000050	深天马A	71,600	646,548.00	2.00
3	600498	烽火通信	18,500	593,480.00	1.84
4	002156	通富微电	15,100	569,270.00	1.77
5	600038	中直股份	14,900	538,337.00	1.67
6	000426	兴业银锡	15,100	537,560.00	1.67
7	600096	云天化	15,500	517,855.00	1.61
8	603341	龙旗科技	11,800	498,668.00	1.55
9	600909	华安证券	67,800	459,684.00	1.43
10	300373	扬杰科技	6,600	448,800.00	1.39
11	300604	长川科技	4,200	425,502.00	1.32
12	603444	吉比特	1,000	423,850.00	1.31
13	300454	深信服	3,600	414,576.00	1.29
14	600166	福田汽车	138,800	405,296.00	1.26
15	300857	协创数据	2,300	387,964.00	1.20
16	601865	福莱特	24,600	385,482.00	1.20
17	600131	国网信通	23,500	379,290.00	1.18
18	600988	赤峰黄金	12,100	378,004.00	1.17
19	600739	辽宁成大	33,300	372,294.00	1.15
20	600685	中船防务	12,800	364,160.00	1.13
21	002414	高德红外	24,400	357,948.00	1.11
22	002841	视源股份	8,800	348,744.00	1.08
23	601168	西部矿业	12,300	339,972.00	1.05
24	600884	杉杉股份	24,100	325,591.00	1.01
25	600959	江苏有线	91,000	313,040.00	0.97
26	600511	国药股份	10,400	299,000.00	0.93
27	600299	安迪苏	32,000	287,040.00	0.89

28	000709	河钢股份	117,000	270,270.00	0.84
29	603699	纽威股份	5,200	270,244.00	0.84
30	601717	中创智领	11,000	270,050.00	0.84
31	002335	科华数据	4,800	266,544.00	0.83
32	600549	厦门钨业	6,200	254,572.00	0.79
33	002436	兴森科技	12,000	254,040.00	0.79
34	300146	汤臣倍健	20,100	241,401.00	0.75
35	000887	中鼎股份	10,000	232,100.00	0.72
36	002056	横店东磁	11,800	230,100.00	0.71
37	601608	中信重工	33,500	220,765.00	0.68
38	301308	江波龙	900	220,356.00	0.68
39	300496	中科创达	3,200	216,000.00	0.67
40	600499	科达制造	15,200	210,824.00	0.65
41	601128	常熟银行	29,200	205,568.00	0.64
42	600517	国网英大	34,100	204,941.00	0.64
43	000539	粤电力A	46,200	204,204.00	0.63
44	603486	科沃斯	2,500	201,700.00	0.63
45	603160	汇顶科技	2,500	197,500.00	0.61
46	300558	贝达药业	4,200	196,098.00	0.61
47	300136	信维通信	3,100	192,200.00	0.60
48	601918	新集能源	28,400	187,724.00	0.58
49	600380	健康元	16,200	187,110.00	0.58
50	600704	物产中大	32,600	181,582.00	0.56
51	002202	金风科技	8,900	181,560.00	0.56
52	002008	大族激光	4,400	181,236.00	0.56
53	600578	京能电力	33,700	171,870.00	0.53
54	601665	齐鲁银行	29,500	169,330.00	0.53
55	600848	上海临港	14,400	168,480.00	0.52
56	002080	中材科技	4,600	167,164.00	0.52
57	600737	中粮糖业	9,500	163,495.00	0.51
58	600906	财达证券	24,100	160,747.00	0.50

59	000750	国海证券	37,900	160,696.00	0.50
60	002410	广联达	12,200	153,476.00	0.48
61	601212	白银有色	25,800	150,930.00	0.47
62	603939	益丰药房	6,900	149,868.00	0.46
63	600528	中铁工业	17,700	144,786.00	0.45
64	000623	吉林敖东	7,300	142,569.00	0.44
65	600170	上海建工	52,700	139,655.00	0.43
66	300724	捷佳伟创	1,400	133,840.00	0.41
67	000733	振华科技	2,400	125,784.00	0.39
68	601228	广州港	38,300	124,092.00	0.38
69	002500	山西证券	20,100	120,399.00	0.37
70	002281	光迅科技	1,700	118,915.00	0.37
71	300888	稳健医疗	3,000	113,520.00	0.35
72	603077	和邦生物	49,800	112,548.00	0.35
73	603049	中策橡胶	2,000	111,900.00	0.35
74	600378	昊华科技	3,500	111,860.00	0.35
75	000783	长江证券	13,700	111,655.00	0.35
76	600582	天地科技	18,900	110,187.00	0.34
77	688235	百济神州-U	400	107,440.00	0.33
78	600095	湘财股份	9,700	107,282.00	0.33
79	301200	大族数控	900	106,893.00	0.33
80	688213	思特威-W	1,118	106,310.62	0.33
81	600098	广州发展	15,900	103,986.00	0.32
82	603379	三美股份	1,700	103,224.00	0.32
83	300972	万辰集团	500	100,535.00	0.31
84	600985	淮北矿业	8,800	97,768.00	0.30
85	601966	玲珑轮胎	6,700	97,351.00	0.30
86	000415	渤海租赁	23,300	94,365.00	0.29
87	600673	东阳光	4,200	94,206.00	0.29
88	300012	华测检测	6,900	93,495.00	0.29
89	688322	奥比中光-U	1,000	89,670.00	0.28

		W			
90	603833	欧派家居	1,700	88,553.00	0.27
91	603658	安图生物	2,400	85,008.00	0.26
92	603606	东方电缆	1,400	83,650.00	0.26
93	002409	雅克科技	1,100	81,510.00	0.25
94	600583	海油工程	14,500	79,605.00	0.25
95	600157	永泰能源	49,600	77,872.00	0.24
96	002299	圣农发展	4,700	77,738.00	0.24
97	601108	财通证券	8,900	77,608.00	0.24
98	603858	步长制药	4,900	76,636.00	0.24
99	603707	健友股份	8,400	75,852.00	0.24
100	300207	欣旺达	2,800	73,220.00	0.23
101	300679	电连技术	1,500	73,020.00	0.23
102	600398	海澜之家	11,900	71,995.00	0.22
103	600369	西南证券	16,000	71,680.00	0.22
104	600312	平高电气	4,100	71,135.00	0.22
105	000598	兴蓉环境	9,700	69,549.00	0.22
106	600008	首创环保	22,900	68,700.00	0.21
107	600754	锦江酒店	2,700	68,229.00	0.21
108	002271	东方雨虹	5,000	67,950.00	0.21
109	600348	华阳股份	8,200	67,732.00	0.21
110	603816	顾家家居	2,200	67,628.00	0.21
111	601577	长沙银行	6,800	65,960.00	0.20
112	600004	白云机场	6,900	65,274.00	0.20
113	601061	中信金属	4,500	64,800.00	0.20
114	000959	首钢股份	12,700	62,230.00	0.19
115	600820	隧道股份	9,500	61,655.00	0.19
116	002603	以岭药业	3,600	61,452.00	0.19
117	688629	华丰科技	600	60,036.00	0.19
118	300140	节能环境	8,500	57,545.00	0.18
119	300763	锦浪科技	800	57,128.00	0.18

120	002353	杰瑞股份	800	56,664.00	0.18
121	300001	特锐德	2,200	56,496.00	0.18
122	601880	辽港股份	34,600	55,360.00	0.17
123	603786	科博达	700	54,670.00	0.17
124	600871	石化油服	25,000	54,000.00	0.17
125	000893	亚钾国际	1,100	52,767.00	0.16
126	688772	珠海冠宇	2,400	51,672.00	0.16
127	000729	燕京啤酒	4,500	50,535.00	0.16
128	688002	睿创微纳	500	50,400.00	0.16
129	601598	中国外运	8,300	50,298.00	0.16
130	600329	达仁堂	1,100	50,182.00	0.16
131	300395	菲利华	500	50,150.00	0.16
132	601106	中国一重	12,500	49,875.00	0.15
133	688819	天能股份	1,400	46,508.00	0.14
134	300458	全志科技	1,100	46,233.00	0.14
135	000951	中国重汽	2,700	45,630.00	0.14
136	002926	华西证券	4,900	45,472.00	0.14
137	600141	兴发集团	1,300	44,954.00	0.14
138	300339	润和软件	900	44,550.00	0.14
139	688347	华虹公司	400	43,148.00	0.13
140	688475	萤石网络	1,400	42,154.00	0.13
141	301536	星宸科技	700	41,937.00	0.13
142	603596	伯特利	800	41,016.00	0.13
143	601233	桐昆股份	2,300	39,583.00	0.12
144	600580	卧龙电驱	800	39,280.00	0.12
145	002738	中矿资源	500	39,275.00	0.12
146	601991	大唐发电	11,000	38,390.00	0.12
147	600546	山煤国际	3,700	37,333.00	0.12
148	688301	奕瑞科技	361	36,500.71	0.11
149	600332	白云山	1,400	36,036.00	0.11
150	600808	马钢股份	8,500	35,870.00	0.11

151	603766	隆鑫通用	2,200	35,442.00	0.11
152	603233	大参林	2,000	35,240.00	0.11
153	300450	先导智能	700	34,986.00	0.11
154	000898	鞍钢股份	13,300	33,649.00	0.10
155	600688	上海石化	11,900	33,082.00	0.10
156	600873	梅花生物	3,200	32,416.00	0.10
157	600352	浙江龙盛	3,000	31,980.00	0.10
158	600602	云赛智联	1,700	31,773.00	0.10
159	002152	广电运通	2,300	31,763.00	0.10
160	601555	东吴证券	3,500	31,710.00	0.10
161	600637	东方明珠	3,200	31,520.00	0.10
162	603899	晨光股份	1,100	29,766.00	0.09
163	603529	爱玛科技	1,000	29,700.00	0.09
164	000987	越秀资本	3,600	29,304.00	0.09
165	603920	世运电路	600	29,046.00	0.09
166	603156	养元饮品	1,000	28,750.00	0.09
167	003035	南网能源	6,200	28,396.00	0.09
168	601156	东航物流	1,500	27,615.00	0.09
169	603659	璞泰来	1,000	27,340.00	0.08
170	688728	格科微	1,800	26,892.00	0.08
171	002624	完美世界	1,600	26,224.00	0.08
172	600032	浙江新能	3,500	25,935.00	0.08
173	300003	乐普医疗	1,600	25,296.00	0.08
174	002673	西部证券	3,200	25,248.00	0.08
175	600885	宏发股份	800	24,320.00	0.08
176	600801	华新建材	900	22,086.00	0.07
177	000933	神火股份	800	21,976.00	0.07
178	300474	景嘉微	300	21,561.00	0.07
179	600392	盛和资源	1,000	21,530.00	0.07
180	688561	奇安信-U	600	21,348.00	0.07
181	300748	金力永磁	600	20,466.00	0.06

182	002517	恺英网络	900	19,683.00	0.06
183	600060	海信视像	800	19,424.00	0.06
184	000657	中钨高新	700	19,397.00	0.06
185	600998	九州通	3,691	18,897.92	0.06
186	600339	中油工程	5,500	18,425.00	0.06
187	000703	恒逸石化	1,700	18,309.00	0.06
188	601231	环旭电子	600	18,000.00	0.06
189	002423	中粮资本	1,500	17,550.00	0.05
190	001696	宗申动力	800	17,352.00	0.05
191	600601	方正科技	1,400	16,408.00	0.05
192	002850	科达利	100	15,786.00	0.05
193	600699	均胜电子	500	15,680.00	0.05
194	002670	国盛证券	900	15,156.00	0.05
195	600663	陆家嘴	1,800	14,238.00	0.04
196	601958	金钼股份	900	14,022.00	0.04
197	002128	电投能源	500	13,955.00	0.04
198	002739	万达电影	1,200	13,584.00	0.04
199	688295	中复神鹰	400	13,124.00	0.04
200	301498	乖宝宠物	200	13,030.00	0.04
201	002558	巨人网络	300	12,987.00	0.04
202	301358	湖南裕能	200	12,932.00	0.04
203	002203	海亮股份	1,000	12,660.00	0.04
204	300735	光弘科技	500	12,430.00	0.04
205	002939	长城证券	1,200	12,240.00	0.04
206	600177	雅戈尔	1,600	12,160.00	0.04
207	002461	珠江啤酒	1,300	12,077.00	0.04
208	601567	三星医疗	500	11,510.00	0.04
209	002958	青农商行	3,700	11,470.00	0.04
210	002831	裕同科技	400	11,404.00	0.04
211	600927	永安期货	700	11,249.00	0.03
212	002244	滨江集团	1,100	11,055.00	0.03

213	600764	中国海防	400	10,936.00	0.03
214	002138	顺络电子	300	10,659.00	0.03
215	002025	航天电器	200	10,026.00	0.03
216	002966	苏州银行	1,200	9,948.00	0.03
217	000921	海信家电	400	9,924.00	0.03
218	600863	内蒙华电	2,100	9,408.00	0.03
219	000932	华菱钢铁	1,600	8,992.00	0.03
220	688248	南网科技	200	8,948.00	0.03
221	600298	安琪酵母	200	8,748.00	0.03
222	601118	海南橡胶	1,400	8,190.00	0.03
223	002085	万丰奥威	500	8,005.00	0.02
224	600566	济川药业	300	7,890.00	0.02
225	603228	景旺电子	100	7,309.00	0.02
226	000563	陕国投A	2,100	7,245.00	0.02
227	000060	中金岭南	1,200	7,020.00	0.02
228	002430	杭氧股份	200	5,974.00	0.02
229	603885	吉祥航空	400	5,952.00	0.02
230	600143	金发科技	300	5,862.00	0.02
231	002508	老板电器	300	5,805.00	0.02
232	600765	中航重机	300	5,748.00	0.02
233	600562	国睿科技	200	5,652.00	0.02
234	603806	福斯特	400	5,584.00	0.02
235	002312	川发龙蟒	500	5,465.00	0.02
236	002340	格林美	600	5,016.00	0.02
237	603737	三棵树	100	4,627.00	0.01
238	300144	宋城演艺	500	4,095.00	0.01
239	002402	和而泰	100	3,912.00	0.01
240	000034	神州数码	100	3,891.00	0.01
241	603927	中科软	200	3,818.00	0.01
242	002195	岩山科技	500	3,545.00	0.01
243	300058	蓝色光标	300	3,456.00	0.01

244	605589	圣泉集团	100	2,830.00	0.01
245	601019	山东出版	300	2,592.00	0.01
246	000728	国元证券	300	2,505.00	0.01
247	600655	豫园股份	400	2,052.00	0.01
248	300017	网宿科技	200	2,050.00	0.01
249	003022	联泓新科	100	1,981.00	0.01
250	300529	健帆生物	100	1,967.00	0.01
251	601696	中银证券	100	1,499.00	0.00
252	002429	兆驰股份	200	1,484.00	0.00
253	000528	柳工	100	1,187.00	0.00
254	601997	贵阳银行	200	1,174.00	0.00
255	000785	居然智家	400	1,168.00	0.00
256	688425	铁建重工	200	1,014.00	0.00
257	601162	天风证券	200	832.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603185	弘元绿能	3,900	118,950.00	0.37
2	600150	中国船舶	3,210	106,764.60	0.33
3	002602	世纪华通	6,000	102,360.00	0.32
4	600745	闻泰科技	2,500	93,200.00	0.29
5	603259	药明康德	1,000	90,640.00	0.28
6	002415	海康威视	2,900	86,536.00	0.27
7	603993	洛阳钼业	4,300	86,000.00	0.27
8	601899	紫金矿业	2,400	82,728.00	0.26
9	002004	华邦健康	16,500	78,870.00	0.24
10	001896	豫能控股	14,300	74,360.00	0.23
11	600104	上汽集团	4,600	70,012.00	0.22

12	601600	中国铝业	5,100	62,322.00	0.19
13	600057	厦门象屿	6,500	55,380.00	0.17
14	002049	紫光国微	700	55,167.00	0.17
15	601898	中煤能源	4,400	54,736.00	0.17
16	300756	金马游乐	900	51,192.00	0.16
17	002074	国轩高科	1,300	50,843.00	0.16
18	600867	通化东宝	6,000	49,020.00	0.15
19	688519	南亚新材	600	48,516.00	0.15
20	300409	道氏技术	2,100	47,229.00	0.15
21	600372	中航机载	3,400	45,628.00	0.14
22	603296	华勤技术	500	45,370.00	0.14
23	600935	华塑股份	18,400	45,080.00	0.14
24	000166	申万宏源	8,400	44,268.00	0.14
25	000768	中航西飞	1,700	43,146.00	0.13
26	300438	鹏辉能源	800	42,576.00	0.13
27	600406	国电南瑞	1,700	38,216.00	0.12
28	601020	华钰矿业	1,400	37,604.00	0.12
29	300190	维尔利	8,300	35,607.00	0.11
30	600100	同方股份	3,900	34,788.00	0.11
31	600362	江西铜业	600	32,952.00	0.10
32	000333	美的集团	400	31,260.00	0.10
33	300008	天海防务	3,900	30,771.00	0.10
34	603876	鼎胜新材	2,000	30,020.00	0.09
35	688595	芯海科技	900	29,520.00	0.09
36	688208	道通科技	800	29,440.00	0.09
37	002556	辉隆股份	4,800	28,992.00	0.09
38	000600	建投能源	3,300	28,149.00	0.09
39	300363	博腾股份	1,200	27,888.00	0.09
40	000725	京东方A	6,200	26,102.00	0.08
41	000800	一汽解放	3,800	25,764.00	0.08
42	688191	智洋创新	800	25,744.00	0.08

43	601901	方正证券	3,300	25,740.00	0.08
44	600626	申达股份	5,300	25,599.00	0.08
45	600989	宝丰能源	1,300	25,519.00	0.08
46	000990	诚志股份	3,100	24,552.00	0.08
47	600050	中国联通	4,600	23,506.00	0.07
48	000778	新兴铸管	5,500	22,990.00	0.07
49	301529	福赛科技	200	22,620.00	0.07
50	300219	鸿利智汇	3,100	22,351.00	0.07
51	600183	生益科技	300	21,423.00	0.07
52	688577	浙海德曼	200	19,372.00	0.06
53	600320	振华重工	3,700	19,055.00	0.06
54	601766	中国中车	2,700	18,414.00	0.06
55	600711	盛屯矿业	1,200	18,192.00	0.06
56	605287	德才股份	700	18,144.00	0.06
57	002664	信质集团	700	16,772.00	0.05
58	605056	咸亨国际	1,000	16,500.00	0.05
59	002787	华源控股	1,300	16,185.00	0.05
60	600742	富维股份	1,600	16,000.00	0.05
61	600662	外服控股	3,100	15,562.00	0.05
62	001979	招商蛇口	1,800	15,552.00	0.05
63	600469	风神股份	2,200	15,268.00	0.05
64	000553	安道麦A	2,700	14,796.00	0.05
65	000552	甘肃能化	6,400	14,784.00	0.05
66	000421	南京公用	2,100	14,511.00	0.04
67	603810	丰山集团	900	14,373.00	0.04
68	301283	聚胶股份	300	14,334.00	0.04
69	600686	金龙汽车	800	14,192.00	0.04
70	002555	三七互娱	600	14,160.00	0.04
71	605196	华通线缆	400	13,896.00	0.04
72	600075	新疆天业	2,800	13,860.00	0.04
73	300682	朗新集团	900	13,689.00	0.04

74	301035	润丰股份	200	13,602.00	0.04
75	601117	中国化学	1,800	13,554.00	0.04
76	002016	世荣兆业	2,300	13,294.00	0.04
77	600155	华创云信	2,000	13,240.00	0.04
78	603071	物产环能	1,000	13,220.00	0.04
79	002649	博彦科技	1,000	13,190.00	0.04
80	688308	欧科亿	400	12,656.00	0.04
81	600308	华泰股份	3,200	12,480.00	0.04
82	600507	方大特钢	2,100	12,369.00	0.04
83	002486	嘉麟杰	3,900	12,129.00	0.04
84	002475	立讯精密	200	11,342.00	0.04
85	300138	晨光生物	900	11,169.00	0.03
86	688135	利扬芯片	400	11,104.00	0.03
87	600257	大湖股份	1,700	10,676.00	0.03
88	002768	国恩股份	200	10,536.00	0.03
89	300132	青松股份	1,200	10,452.00	0.03
90	300715	凯伦股份	1,000	10,440.00	0.03
91	600661	昂立教育	1,000	10,250.00	0.03
92	600569	安阳钢铁	4,500	10,125.00	0.03
93	301216	万凯新材	600	10,116.00	0.03
94	300047	天源迪科	800	10,040.00	0.03
95	600067	冠城新材	2,400	9,960.00	0.03
96	603500	祥和实业	800	9,584.00	0.03
97	600180	瑞茂通	2,700	9,450.00	0.03
98	002048	宁波华翔	300	9,438.00	0.03
99	300055	万邦达	1,100	8,965.00	0.03
100	600120	浙江东方	1,400	8,638.00	0.03
101	603901	永创智能	600	8,520.00	0.03
102	600325	华发股份	2,000	8,440.00	0.03
103	002695	煌上煌	700	8,218.00	0.03
104	002493	荣盛石化	700	8,197.00	0.03

105	000708	中信特钢	500	8,185.00	0.03
106	002102	能特科技	2,400	7,992.00	0.02
107	301115	联检科技	500	7,905.00	0.02
108	603045	福达合金	400	7,860.00	0.02
109	002001	新和成	300	7,557.00	0.02
110	600288	大恒科技	500	7,490.00	0.02
111	600011	华能国际	1,000	7,460.00	0.02
112	688219	会通股份	600	7,452.00	0.02
113	301153	中科江南	300	7,416.00	0.02
114	300658	延江股份	500	7,410.00	0.02
115	603170	宝立食品	500	7,140.00	0.02
116	002511	中顺洁柔	800	6,848.00	0.02
117	600346	恒力石化	300	6,759.00	0.02
118	002957	科瑞技术	300	6,495.00	0.02
119	002075	沙钢股份	1,100	6,325.00	0.02
120	603313	梦百合	700	6,230.00	0.02
121	600114	东睦股份	200	6,110.00	0.02
122	601033	永兴股份	400	6,052.00	0.02
123	601636	旗滨集团	1,000	5,930.00	0.02
124	002399	海普瑞	500	5,895.00	0.02
125	600887	伊利股份	200	5,720.00	0.02
126	000422	湖北宜化	400	5,684.00	0.02
127	002222	福晶科技	100	5,634.00	0.02
128	000792	盐湖股份	200	5,632.00	0.02
129	300257	开山股份	400	5,620.00	0.02
130	601808	中海油服	400	5,616.00	0.02
131	600768	宁波富邦	400	5,600.00	0.02
132	600216	浙江医药	400	5,544.00	0.02
133	300739	明阳电路	300	5,514.00	0.02
134	603385	惠达卫浴	800	5,472.00	0.02
135	601512	中新集团	600	5,400.00	0.02

136	600219	南山铝业	1,000	5,380.00	0.02
137	300442	润泽科技	100	5,280.00	0.02
138	002440	闰土股份	700	5,229.00	0.02
139	600176	中国巨石	300	5,130.00	0.02
140	002758	浙农股份	500	5,035.00	0.02
141	002483	润邦股份	700	4,998.00	0.02
142	300511	雪榕生物	800	4,992.00	0.02
143	600382	广东明珠	700	4,991.00	0.02
144	600039	四川路桥	500	4,975.00	0.02
145	002552	宝鼎科技	300	4,953.00	0.02
146	300358	楚天科技	500	4,895.00	0.02
147	600983	惠而浦	500	4,780.00	0.01
148	000597	东北制药	900	4,698.00	0.01
149	600748	上实发展	800	4,336.00	0.01
150	601857	中国石油	400	4,164.00	0.01
151	600429	三元股份	800	4,144.00	0.01
152	300850	新强联	100	4,137.00	0.01
153	300228	富瑞特装	400	3,956.00	0.01
154	603685	晨丰科技	200	3,898.00	0.01
155	002793	罗欣药业	800	3,840.00	0.01
156	600078	澄星股份	400	3,836.00	0.01
157	600558	大西洋	600	3,660.00	0.01
157	300098	高新兴	600	3,660.00	0.01
159	002051	中工国际	400	3,628.00	0.01
160	000012	南玻A	800	3,544.00	0.01
161	002092	中泰化学	700	3,486.00	0.01
162	600361	创新新材	800	3,392.00	0.01
163	000555	神州信息	200	3,310.00	0.01
164	600415	小商品城	200	3,190.00	0.01
165	603889	新澳股份	400	3,180.00	0.01
165	000543	皖能电力	400	3,180.00	0.01

167	300129	泰胜风能	300	3,138.00	0.01
168	000603	盛达资源	100	3,096.00	0.01
169	603588	高能环境	400	3,088.00	0.01
170	300775	三角防务	100	3,040.00	0.01
171	600488	津药药业	700	2,863.00	0.01
172	600966	博汇纸业	400	2,732.00	0.01
173	002023	海特高新	200	2,708.00	0.01
174	002171	楚江新材	200	2,652.00	0.01
175	002454	松芝股份	300	2,613.00	0.01
176	002258	利尔化学	200	2,610.00	0.01
177	002731	萃华珠宝	200	2,512.00	0.01
178	000975	山金国际	100	2,433.00	0.01
179	600080	金花股份	300	2,262.00	0.01
180	600089	特变电工	100	2,222.00	0.01
180	300435	中泰股份	100	2,222.00	0.01
182	600710	苏美达	200	2,162.00	0.01
183	002111	威海广泰	200	2,104.00	0.01
184	605138	盛泰集团	300	2,088.00	0.01
185	300871	回盛生物	100	2,073.00	0.01
186	600482	中国动力	100	2,070.00	0.01
187	603126	中材节能	300	2,016.00	0.01
188	600718	东软集团	200	2,014.00	0.01
189	002328	新朋股份	300	1,983.00	0.01
190	002573	清新环境	500	1,870.00	0.01
191	002062	宏润建设	200	1,850.00	0.01
192	603848	好太太	100	1,827.00	0.01
193	300036	超图软件	100	1,816.00	0.01
194	603050	科林电气	100	1,802.00	0.01
195	600827	百联股份	200	1,798.00	0.01
196	600063	皖维高新	300	1,767.00	0.01
197	600300	维维股份	500	1,755.00	0.01

198	603112	华翔股份	100	1,737.00	0.01
199	600388	龙净环保	100	1,631.00	0.01
200	600597	光明乳业	200	1,618.00	0.01
201	603038	华立股份	100	1,610.00	0.00
202	600051	宁波联合	200	1,508.00	0.00
203	300861	美畅股份	100	1,493.00	0.00
204	600210	紫江企业	200	1,470.00	0.00
205	300249	依米康	100	1,463.00	0.00
206	603997	继峰股份	100	1,390.00	0.00
207	002012	凯恩股份	200	1,290.00	0.00
208	300464	星徽股份	200	1,268.00	0.00
209	600577	精达股份	100	1,243.00	0.00
210	300824	北鼎股份	100	1,131.00	0.00
211	002419	天虹股份	200	1,106.00	0.00
212	601868	中国能建	400	940.00	0.00
212	000058	深赛格	100	940.00	0.00
214	000998	隆平高科	100	936.00	0.00
215	601311	骆驼股份	100	917.00	0.00
216	300263	隆华科技	100	884.00	0.00
217	603808	歌力思	100	852.00	0.00
218	300933	中辰股份	100	829.00	0.00
219	600675	中华企业	300	813.00	0.00
220	000156	华数传媒	100	757.00	0.00
221	300232	洲明科技	100	709.00	0.00
222	601339	百隆东方	100	579.00	0.00
223	002563	森马服饰	100	542.00	0.00
224	300072	海新能科	100	460.00	0.00
225	601018	宁波港	100	363.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601168	西部矿业	2,575,580.00	7.21
2	002138	顺络电子	2,316,173.00	6.49
3	600685	中船防务	2,220,441.00	6.22
4	600166	福田汽车	2,190,623.00	6.13
5	000887	中鼎股份	2,150,796.00	6.02
6	601717	中创智领	2,142,579.00	6.00
7	300476	胜宏科技	2,080,343.00	5.82
8	600959	江苏有线	2,073,664.00	5.81
9	600998	九州通	2,044,149.00	5.72
10	002056	横店东磁	2,026,759.00	5.67
11	600380	健康元	1,985,671.00	5.56
12	600909	华安证券	1,972,283.00	5.52
13	300373	扬杰科技	1,960,332.00	5.49
14	002841	视源股份	1,943,367.00	5.44
15	002500	山西证券	1,897,290.00	5.31
16	600038	中直股份	1,895,131.00	5.31
17	600582	天地科技	1,883,600.00	5.27
18	600299	安迪苏	1,848,810.00	5.18
19	601568	北元集团	1,848,013.00	5.17
20	600499	科达制造	1,811,544.00	5.07
21	601555	东吴证券	1,808,205.00	5.06
22	600739	辽宁成大	1,792,155.00	5.02
23	000050	深天马A	1,759,380.00	4.93
24	000783	长江证券	1,725,957.00	4.83
25	300454	深信服	1,703,743.00	4.77
26	002410	广联达	1,695,358.00	4.75
27	600498	烽火通信	1,673,354.00	4.69

28	600131	国网信通	1,670,158.00	4.68
29	000709	河钢股份	1,666,758.00	4.67
30	603341	龙旗科技	1,640,024.00	4.59
31	300207	欣旺达	1,623,333.30	4.55
32	000728	国元证券	1,617,578.00	4.53
33	002202	金风科技	1,573,212.00	4.40
34	600098	广州发展	1,569,029.00	4.39
35	600352	浙江龙盛	1,552,456.00	4.35
36	600096	云天化	1,552,059.00	4.35
37	600578	京能电力	1,543,997.00	4.32
38	300496	中科创达	1,541,256.00	4.32
39	600704	物产中大	1,537,474.00	4.30
40	601231	环旭电子	1,535,633.00	4.30
41	002414	高德红外	1,496,999.00	4.19
42	300073	当升科技	1,484,279.00	4.16
43	601665	齐鲁银行	1,480,961.00	4.15
44	600885	宏发股份	1,470,239.00	4.12
45	600435	北方导航	1,441,023.00	4.03
46	300604	长川科技	1,439,719.00	4.03
47	002273	水晶光电	1,439,651.00	4.03
48	600062	华润双鹤	1,429,154.00	4.00
49	600312	平高电气	1,424,171.00	3.99
50	688469	芯联集成-U	1,416,137.28	3.97
51	002532	天山铝业	1,395,594.00	3.91
52	600271	航天信息	1,345,519.00	3.77
53	600884	杉杉股份	1,323,960.00	3.71
54	002926	华西证券	1,320,925.00	3.70
55	000060	中金岭南	1,316,926.00	3.69
56	600298	安琪酵母	1,298,369.00	3.64
57	600109	国金证券	1,292,656.00	3.62
58	603233	大参林	1,279,588.00	3.58

59	600549	厦门钨业	1,268,095.00	3.55
60	688213	思特威-W	1,264,591.97	3.54
61	300458	全志科技	1,262,201.00	3.53
62	600699	均胜电子	1,246,725.00	3.49
63	002340	格林美	1,242,377.00	3.48
64	600563	法拉电子	1,225,955.00	3.43
65	600764	中国海防	1,196,901.00	3.35
66	002156	通富微电	1,185,590.00	3.32
67	300001	特锐德	1,180,653.00	3.31
68	000988	华工科技	1,175,888.00	3.29
69	600873	梅花生物	1,175,214.00	3.29
70	601019	山东出版	1,172,367.00	3.28
71	600988	赤峰黄金	1,166,065.00	3.26
72	300724	捷佳伟创	1,163,134.28	3.26
73	002461	珠江啤酒	1,147,545.00	3.21
74	600867	通化东宝	1,115,205.00	3.12
75	300677	英科医疗	1,109,944.00	3.11
76	603444	吉比特	1,092,134.00	3.06
77	601958	金钼股份	1,076,878.00	3.02
78	601098	中南传媒	1,068,731.00	2.99
79	600079	ST人福	1,061,914.00	2.97
80	601179	中国西电	1,060,359.00	2.97
81	301308	江波龙	1,054,125.00	2.95
82	002384	东山精密	1,051,263.00	2.94
83	603529	爱玛科技	1,043,256.00	2.92
84	601918	新集能源	1,042,087.00	2.92
85	000021	深科技	1,041,367.00	2.92
86	601128	常熟银行	1,040,707.00	2.91
87	600487	亨通光电	1,032,694.00	2.89
88	002152	广电运通	992,017.00	2.78
89	603659	璞泰来	987,924.00	2.77

90	300857	协创数据	986,570.00	2.76
91	002436	兴森科技	983,755.00	2.75
92	002595	豪迈科技	982,872.00	2.75
93	002203	海亮股份	973,252.00	2.73
94	300017	网宿科技	965,752.00	2.70
95	000623	吉林敖东	965,311.00	2.70
96	601577	长沙银行	963,492.00	2.70
97	601108	财通证券	960,750.00	2.69
98	300395	菲利华	946,089.00	2.65
99	601966	玲珑轮胎	939,662.00	2.63
100	600663	陆家嘴	938,332.00	2.63
101	603979	金诚信	937,027.00	2.62
102	600060	海信视像	922,170.00	2.58
103	600906	财达证券	919,133.00	2.57
104	301165	锐捷网络	914,476.00	2.56
105	603087	甘李药业	913,656.00	2.56
106	002958	青农商行	898,696.00	2.52
107	002624	完美世界	886,363.00	2.48
108	603658	安图生物	885,977.85	2.48
109	603129	春风动力	885,833.00	2.48
110	000009	中国宝安	873,228.00	2.45
111	603160	汇顶科技	871,504.00	2.44
112	600325	华发股份	866,479.00	2.43
113	688772	珠海冠宇	853,517.66	2.39
114	603486	科沃斯	851,684.00	2.38
115	600511	国药股份	850,591.00	2.38
116	600517	国网英大	846,734.00	2.37
117	002368	太极股份	829,909.00	2.32
118	600535	天士力	828,994.00	2.32
119	000729	燕京啤酒	827,407.00	2.32
120	603379	三美股份	826,263.00	2.31

121	600956	新天绿能	824,138.00	2.31
122	300803	指南针	820,873.00	2.30
123	600007	中国国贸	816,737.00	2.29
124	600637	东方明珠	811,333.00	2.27
125	000426	兴业银锡	801,272.00	2.24
126	002244	滨江集团	795,089.00	2.23
127	600143	金发科技	789,942.00	2.21
128	000683	博源化工	783,553.00	2.19
129	000937	冀中能源	781,513.00	2.19
130	000039	中集集团	769,540.00	2.15
131	603893	瑞芯微	769,353.00	2.15
132	603225	新凤鸣	763,636.00	2.14
133	002185	华天科技	763,574.00	2.14
134	002299	圣农发展	762,881.00	2.14
135	601991	大唐发电	750,689.00	2.10
136	600157	永泰能源	748,551.00	2.10
137	600170	上海建工	747,527.00	2.09
138	688475	萤石网络	740,177.11	2.07
139	000960	锡业股份	737,762.00	2.07
140	600258	首旅酒店	724,265.00	2.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	3,391,868.00	9.50
2	601168	西部矿业	2,645,638.00	7.41
3	601555	东吴证券	2,531,627.00	7.09
4	601717	中创智领	2,510,071.00	7.03
5	002138	顺络电子	2,476,760.00	6.93

6	600380	健康元	2,420,274.00	6.78
7	600998	九州通	2,365,357.00	6.62
8	002500	山西证券	2,180,812.00	6.11
9	600959	江苏有线	2,122,801.00	5.94
10	002410	广联达	2,057,381.00	5.76
11	000887	中鼎股份	2,054,854.00	5.75
12	600578	京能电力	2,039,830.00	5.71
13	000060	中金岭南	1,991,868.00	5.58
14	600166	福田汽车	1,963,831.00	5.50
15	600685	中船防务	1,938,349.00	5.43
16	601568	北元集团	1,925,434.00	5.39
17	002056	横店东磁	1,894,480.00	5.30
18	000783	长江证券	1,886,909.00	5.28
19	600582	天地科技	1,871,650.00	5.24
20	002273	水晶光电	1,819,170.00	5.09
21	300207	欣旺达	1,805,813.10	5.06
22	600885	宏发股份	1,788,977.40	5.01
23	688469	芯联集成-U	1,772,392.63	4.96
24	000709	河钢股份	1,761,642.00	4.93
25	000050	深天马A	1,749,854.00	4.90
26	601231	环旭电子	1,741,063.00	4.87
27	600299	安迪苏	1,739,113.00	4.87
28	002841	视源股份	1,722,464.00	4.82
29	002202	金风科技	1,718,797.00	4.81
30	600435	北方导航	1,705,523.00	4.78
31	600909	华安证券	1,695,005.00	4.75
32	600499	科达制造	1,690,286.00	4.73
33	300373	扬杰科技	1,682,422.00	4.71
34	600739	辽宁成大	1,633,540.00	4.57
35	000728	国元证券	1,573,342.00	4.41
36	600352	浙江龙盛	1,554,972.00	4.35

37	002532	天山铝业	1,542,353.00	4.32
38	600704	物产中大	1,535,958.00	4.30
39	600498	烽火通信	1,532,310.00	4.29
40	600096	云天化	1,528,569.00	4.28
41	600699	均胜电子	1,527,584.00	4.28
42	002340	格林美	1,517,331.00	4.25
43	600098	广州发展	1,515,609.00	4.24
44	601179	中国西电	1,505,343.00	4.21
45	601665	齐鲁银行	1,496,836.00	4.19
46	600764	中国海防	1,477,825.00	4.14
47	600062	华润双鹤	1,456,233.00	4.08
48	600312	平高电气	1,449,058.00	4.06
49	002926	华西证券	1,430,683.00	4.01
50	300454	深信服	1,417,498.00	3.97
51	600298	安琪酵母	1,414,767.00	3.96
52	002414	高德红外	1,399,565.00	3.92
53	300001	特锐德	1,390,058.00	3.89
54	000988	华工科技	1,388,474.00	3.89
55	600131	国网信通	1,383,295.00	3.87
56	600271	航天信息	1,364,543.00	3.82
57	300496	中科创达	1,355,050.00	3.79
58	600038	中直股份	1,343,689.00	3.76
59	600109	国金证券	1,337,651.00	3.75
60	600563	法拉电子	1,329,167.00	3.72
61	300604	长川科技	1,302,251.00	3.65
62	603233	大参林	1,252,434.00	3.51
63	600487	亨通光电	1,250,434.00	3.50
64	600060	海信视像	1,234,477.00	3.46
65	600867	通化东宝	1,206,072.00	3.38
66	600925	苏能股份	1,184,269.00	3.32
67	300677	英科医疗	1,160,355.00	3.25

68	002461	珠江啤酒	1,157,992.00	3.24
69	002384	东山精密	1,148,644.00	3.22
70	600549	厦门钨业	1,147,799.00	3.21
71	600143	金发科技	1,146,323.00	3.21
72	603341	龙旗科技	1,145,292.00	3.21
73	688213	思特威-W	1,144,595.31	3.20
74	601958	金钼股份	1,137,975.00	3.19
75	601019	山东出版	1,137,462.00	3.18
76	000021	深科技	1,134,987.00	3.18
77	600884	杉杉股份	1,131,399.00	3.17
78	300458	全志科技	1,130,429.90	3.17
79	600873	梅花生物	1,130,304.00	3.16
80	600079	ST人福	1,117,964.00	3.13
81	603658	安图生物	1,104,978.45	3.09
82	688772	珠海冠宇	1,101,557.75	3.08
83	601098	中南传媒	1,067,416.00	2.99
84	603129	春风动力	1,065,786.00	2.98
85	300724	捷佳伟创	1,051,390.00	2.94
86	600517	国网英大	1,048,233.00	2.94
87	301165	锐捷网络	1,048,151.40	2.93
88	000039	中集集团	1,043,337.00	2.92
89	603087	甘李药业	1,040,242.00	2.91
90	002595	豪迈科技	1,030,439.00	2.89
91	600879	航天电子	1,025,044.00	2.87
92	300395	菲利华	1,024,854.00	2.87
93	300017	网宿科技	1,021,636.00	2.86
94	603659	璞泰来	1,015,925.00	2.84
95	000997	新大陆	1,000,217.00	2.80
96	300866	安克创新	987,076.60	2.76
97	601577	长沙银行	975,116.00	2.73
98	002152	广电运通	970,903.00	2.72

99	603979	金诚信	967,688.16	2.71
100	002203	海亮股份	959,947.00	2.69
101	002517	恺英网络	958,103.00	2.68
102	300803	指南针	957,721.00	2.68
103	603529	爱玛科技	956,615.00	2.68
104	000009	中国宝安	954,408.00	2.67
105	600988	赤峰黄金	953,244.00	2.67
106	601108	财通证券	952,978.00	2.67
107	600663	陆家嘴	937,375.00	2.62
108	600325	华发股份	927,680.00	2.60
109	300073	当升科技	925,727.00	2.59
110	000729	燕京啤酒	919,163.00	2.57
111	600535	天士力	896,637.00	2.51
112	002185	华天科技	886,608.89	2.48
113	002958	青农商行	882,205.00	2.47
114	601997	贵阳银行	870,717.18	2.44
115	300054	鼎龙股份	865,879.00	2.42
116	603893	瑞芯微	858,439.00	2.40
117	600765	中航重机	856,113.00	2.40
118	601966	玲珑轮胎	854,718.00	2.39
119	000623	吉林敖东	848,260.00	2.38
120	600258	首旅酒店	843,539.00	2.36
121	601128	常熟银行	841,395.34	2.36
122	601866	中远海发	837,872.00	2.35
123	301308	江波龙	837,281.00	2.34
124	600956	新天绿能	836,202.00	2.34
125	600170	上海建工	832,419.00	2.33
126	600637	东方明珠	828,930.00	2.32
127	601918	新集能源	828,617.00	2.32
128	002368	太极股份	822,667.00	2.30
129	002385	大北农	821,364.00	2.30

130	600282	南钢股份	815,766.00	2.28
131	600007	中国国贸	811,785.00	2.27
132	002624	完美世界	800,325.00	2.24
133	600361	创新新材	796,199.00	2.23
134	603225	新凤鸣	794,117.00	2.22
135	000960	锡业股份	792,205.00	2.22
136	600968	海油发展	784,065.00	2.20
137	300115	长盈精密	777,743.00	2.18
138	601991	大唐发电	774,511.00	2.17
139	000683	博源化工	773,621.00	2.17
140	002244	滨江集团	772,821.00	2.16
141	000937	冀中能源	771,766.00	2.16
142	603228	景旺电子	762,828.00	2.14
143	600906	财达证券	755,009.00	2.11
144	002436	兴森科技	741,238.00	2.08
145	002625	光启技术	734,337.00	2.06
146	603298	杭叉集团	732,781.00	2.05
147	601061	中信金属	727,001.00	2.04
148	600095	湘财股份	725,290.00	2.03
149	603379	三美股份	717,169.00	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	324,966,680.60
卖出股票收入（成交）总额	336,771,381.58

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

### 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,135.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,135.25
---	----	-----------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §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
中加 中证5 00指 数增 强A	582	14,736.19	0.00	0.00%	8,576,460.06	100.00%
中加 中证5 00指 数增	1,1 49	14,980.48	0.00	0.00%	17,212,573.56	100.00%

强C						
合计	1,731	14,898.34	0.00	0.00%	25,789,033.62	100.00%

### 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	中加中证500指数增强A	151,850.77	1.77%
	中加中证500指数增强C	549,673.37	3.19%
	合计	701,524.14	2.72%

### 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	中加中证500指数增强A	0~10
	中加中证500指数增强C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中加中证500指数增强A	0~10
	中加中证500指数增强C	50~100
	合计	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	中加中证500指数增强A	中加中证500指数增强C
基金合同生效日(2020年09月27日)基金份额总额	96,019,344.11	108,963,659.56
本报告期期初基金份额总额	13,715,859.62	24,158,638.68

本报告期基金总申购份额	12,496,889.18	40,708,565.10
减：本报告期基金总赎回份额	17,636,288.74	47,654,630.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,576,460.06	17,212,573.56

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式二次召开了中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会。大会表决时间自2025年2月26日起，至2025年3月24日17:00止。根据计票结果，本次会议未达到法定的基金份额持有人大会（二次召开）条件。此外，本基金以通讯方式召开了中加证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会。大会表决时间自2025年9月27日起，至2025年10月27日17:00止。根据计票结果，本次会议未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。基金管理人已就上述会议情况报中国证券监督管理委员会备案。

### 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

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：本报告期内，夏远洋先生于2025年7月15日离任公司董事长、法定代表人，杨琳女士自同日起担任公司董事长、法定代表人；李莹女士于2025年12月18日离任公司总经理，自离任之日起由陈昕先生代履行总经理职责。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况：自2025年12月起，中信建投证券股份有限公司托管部高级管理人员增加邱珂磊为托管部联席负责人。自2026年1月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

### 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

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。本报告期内应支付审计费0元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	661,724,662.89	100.00%	133,462.37	100.00%	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力：研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，研究报告分析严谨，观点独立、客观；在符合相关法规及执业规范的前提下，能根据公司的特定要求提供专题研究报告；具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会等；
- (4) 交易能力：证券交易的交易委托和成交回报的及时性和有效性。

## 2. 券商及交易单元的选择流程如下：

(1) 权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

(2) 总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜，集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

## 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
中信建投证券	2,188.20	100.00%	40,910,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 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	中加中证500指数增强型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-01-21
2	中加基金管理有限公司关于以通讯开会方式二次召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-02-21
3	中加基金管理有限公司关于以通讯开会方式二次召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-02-24
4	中加基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2025-02-25

	以通讯开会方式二次召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
5	中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
6	中加中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
7	关于中加基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
8	中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-25
9	中加中证500指数增强型证券投资基金（A类份额）产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-25
10	中加中证500指数增强型证券投资基金（C类份额）产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-25
11	中加基金管理有限公司关于中加中证500指数增强型证券投资基金二次召开基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-26
12	中加中证500指数增强型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-28
13	中加中证500指数增强型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-22
14	中加中证500指数增强型证券投资基金2025年第2季度	中国证监会指定报刊及网站	2025-07-21

	报告		
15	中加中证500指数增强型证券投资基金2025年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-08-29
16	中加基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-24
17	中加基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-25
18	中加基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-09-26
19	中加中证500指数增强型证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-10-28
20	中加基金管理有限公司关于中加中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-10-29

## §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
个	1	20251022-20251104	0.00	8,291,186.47	8,291,186.47	0.00	0.00%

人						
产品特有风险						
<p>本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。</p>						

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§13 备查文件目录**

**13.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准中加中证500指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加中证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、营业执照和公司章程

**13.2 存放地点**

基金管理人处

**13.3 查阅方式**

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼  
 投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司  
 客服电话：400-00-95526（免长途费）  
 基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司  
 二〇二六年三月二十七日