
中加中证A500指数增强型发起式证券投资基金

2026年第2季度报告

2026年06月30日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026年07月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加中证A500指数增强发起式
基金主代码	022804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年01月24日
报告期末基金份额总额	360,537,194.18份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证A500指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
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8%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、同业存单投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股票期权投资策略；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、现金管理策略。

业绩比较基准	中证A500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	本基金属于股票指数增强型基金，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。	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加中证A500指数增强发起式A	中加中证A500指数增强发起式C
下属分级基金的交易代码	022804	022805
报告期末下属分级基金的份额总额	213,853,356.92份	146,683,837.26份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年04月01日 - 2026年06月30日)	
	中加中证A500指数增强发起式A	中加中证A500指数增强发起式C
1.本期已实现收益	14,687,427.69	8,958,650.85
2.本期利润	41,708,933.70	23,807,947.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.1641	0.1589
4.期末基金资产净值	297,560,215.33	202,957,584.42
5.期末基金份额净值	1.3914	1.3836

注：1.上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。

3.2 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A500指数增强发起式A净值表现

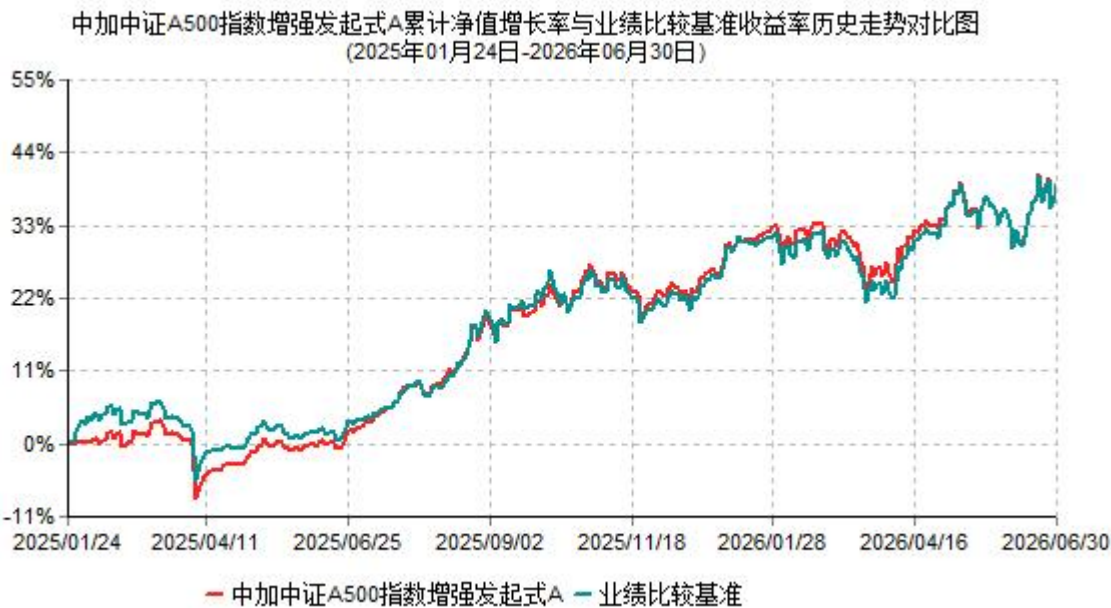
阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

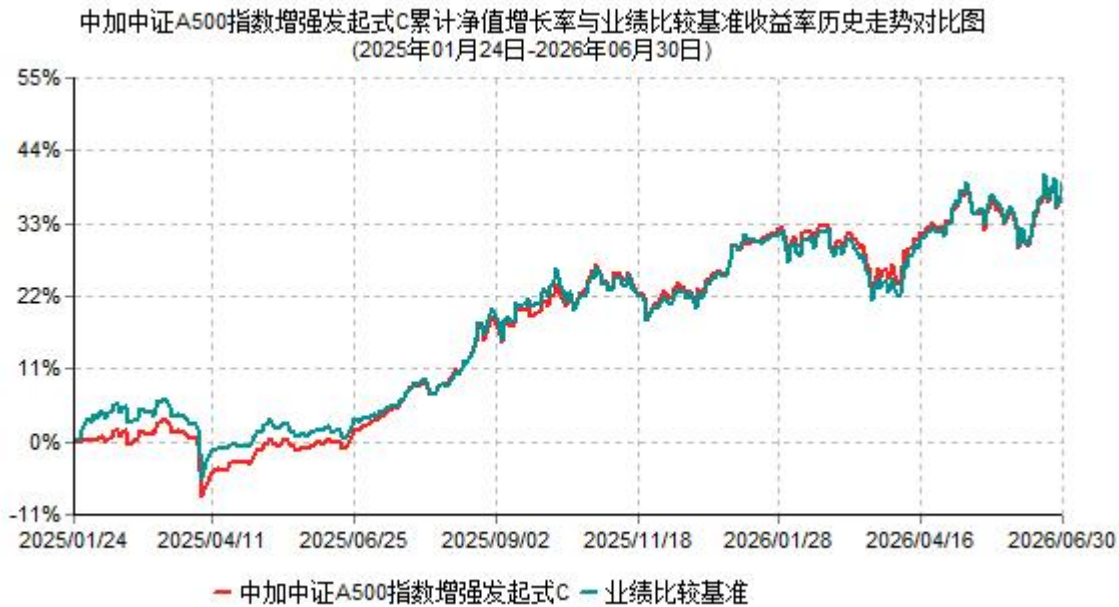
	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	10.92%	1.27%	13.54%	1.34%	-2.62%	-0.07%
过去六个月	10.74%	1.19%	11.34%	1.22%	-0.60%	-0.03%
过去一年	35.89%	1.03%	34.41%	1.09%	1.48%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	39.14%	1.02%	39.22%	1.07%	-0.08%	-0.05%

中加中证A500指数增强发起式C净值表现

阶段	净值增长 率①	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	10.81%	1.27%	13.54%	1.34%	-2.73%	-0.07%
过去六个月	10.52%	1.19%	11.34%	1.22%	-0.82%	-0.03%
过去一年	35.36%	1.03%	34.41%	1.09%	0.95%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	38.36%	1.02%	39.22%	1.07%	-0.86%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注：1. 本基金基金合同于 2025 年 1 月 24 日生效，截止报告期末，本基金基金合同生效已满一年。

2. 按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金建仓期已结束。建仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林沐尘	本基金基金经理	2025-01-24	-	8	林沐尘先生，对外经济贸易大学金融学硕士。2017年7月至2021年3月，就职于工银瑞信基金管理有限公司，任量化研究员。2021年3月至2022年6月，就职于中国国际金融股份有限公司股票业务部，任投资经理。2022年6月加入中加基金管理有限公司,现任基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部规章，制定了《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，并规定对买卖股票、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。本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度A股市场极致分化，从五月开始至今，A股只有半导体、通信等行业上涨，其他行业、风格内股票几乎无差别下跌，科技行业从成交额占比、持仓比重等各个维度上看都处在极度亢奋状态。但AI下游其实问题已经日益凸显，包括大厂限制Token使用，数据中心延迟建设等等。因此我们认为后续风格收敛可能性逐渐加大，许多由于流动性被错杀的资产具有较好性价比。

二季度本基金超额收益较弱，量价类因子相对表现较弱，量化类策略在这样极致的市场中也受到较大冲击，但其相对低波动的属性在后续行情中会有较好的表现。

本基金策略会相对贴近指数，在指数增强品类中跟踪误差相对较小。量化模型通常在市场相对稳定的时候表现较好，长期来看具有一定超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证A500指数增强发起式A基金份额净值为1.3914元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.92%，同期业绩比较基准收益率为13.54%；截至报告期末中加中证A500指数增强发起式C基金份额净值为1.3836元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.81%，同期业绩比较基准收益率为13.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	470,704,861.26	93.45
	其中：股票	470,704,861.26	93.45
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	27,781,956.93	5.52
8	其他资产	5,190,793.11	1.03
9	合计	503,677,611.30	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	26,305,299.00	5.26
C	制造业	273,531,019.01	54.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,034,924.00	2.00
E	建筑业	5,066,032.00	1.01
F	批发和零售业	6,323,340.00	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	7,071,433.00	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,352,370.00	3.27
J	金融业	41,460,600.00	8.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,041,940.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	6,972,560.00	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	1,476,508.00	0.29
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	395,636,025.01	79.05

5.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,232,818.08	9.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	837,446.71	0.17

E	建筑业	691,115.00	0.14
F	批发和零售业	3,945,753.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	1,320,173.46	0.26
H	住宿和餐饮业	1,145,472.00	0.23
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	3,211,911.00	0.64
J	金融业	3,582,799.00	0.72
K	房地产业	5,385,296.00	1.08
L	租赁和商务服务业	3,002,821.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	1,621,503.00	0.32
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	2,091,728.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	75,068,836.25	15.00

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300308	中际旭创	18,300	23,241,000.00	4.64
2	300750	宁德时代	42,000	16,506,420.00	3.30
3	300502	新易盛	24,232	14,708,824.00	2.94
4	603986	兆易创新	11,500	9,372,500.00	1.87
5	600519	贵州茅台	7,400	8,772,626.00	1.75

6	688256	寒武纪	5,400	8,615,970.00	1.72
7	600036	招商银行	221,600	7,866,800.00	1.57
8	601899	紫金矿业	301,600	7,582,224.00	1.51
9	601318	中国平安	158,800	7,581,112.00	1.51
10	603259	药明康德	56,000	6,972,560.00	1.39

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301280	珠城科技	48,300	2,442,531.00	0.49
2	603676	卫信康	285,800	2,300,690.00	0.46
3	603587	地素时尚	205,000	2,277,550.00	0.46
4	600533	栖霞建设	1,178,300	2,226,987.00	0.44
5	603511	爱慕股份	187,000	2,150,500.00	0.43

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其他主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,190,793.11
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,190,793.11

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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未存在流通受限的情况。

5.11.5.2 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未存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中加中证A500指数增强 发起式A	中加中证A500指数增强 发起式C
报告期期初基金份额总额	323,477,057.27	184,764,779.38

报告期期间基金总申购份额	191,000,725.07	112,812,232.54
减：报告期期间基金总赎回份额	300,624,425.42	150,893,174.66
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	213,853,356.92	146,683,837.26

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

	中加中证A500指数增强发起式A	中加中证A500指数增强发起式C
报告期期初管理人持有的本基金份额	20,027,116.60	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,027,116.60	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.36	-

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	20,027,116.60	5.55%	10,000,350.04	2.77%	3年
基金管理人高级管理人员	89,662.25	0.02%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	20,116,778.85	5.57%	10,000,350.04	2.77%	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加中证A500指数增强型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《中加中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中加中证A500指数增强型发起式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

10.2 存放地点

基金管理人处

10.3 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

2026年07月21日