

# 中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
7.6 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	67
7.7 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	68
7.8 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	68
7.9 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	68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70

8.3 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 .....	70
§9 开放式基金份额变动 .....	70
§10 重大事件揭示 .....	70
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
10.2 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 .....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
10.4 基金投资策略的改变 .....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
10.8 其他重大事件 .....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
11.1 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 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
§12 备查文件目录 .....	76
12.1 备查文件目录 .....	76
12.2 存放地点 .....	76
12.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证500增强	
基金主代码	006440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月09日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	123,576,595.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
下属各类别基金的交易代码	006440	006441
报告期末下属各类别基金的份额总额	72,914,008.16份	50,662,587.56份

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久	杨军智
	联系电话	010-57760122	010-60834299
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		4009-108-108	010-60836588
传真		010-59100298	010-60834004
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码		100010	100125
法定代表人		黄凌	张佑君

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
本期已实现收益	10,112,628.91	6,551,110.70
本期利润	13,267,345.04	7,831,059.43
加权平均基金份额本期利润	0.2352	0.2178
本期加权平均净值利润率	16.78%	15.61%
本期基金份额净值增长率	16.10%	15.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
期末可供分配利润	36,814,880.66	25,319,701.03
期末可供分配基金份额利润	0.5049	0.4998
期末基金资产净值	110,492,699.54	76,509,052.15
期末基金份额净值	1.5154	1.5102
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
基金份额累计净值增长率	51.54%	51.02%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投中证500增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.57%	0.76%	1.12%	0.69%	2.45%	0.07%
过去三个月	10.86%	0.67%	8.41%	0.65%	2.45%	0.02%
过去六个月	16.10%	0.93%	6.61%	0.94%	9.49%	-0.01%
过去一年	38.18%	1.24%	15.35%	1.19%	22.83%	0.05%
自基金合同 生效起至今	51.54%	1.18%	22.45%	1.15%	29.09%	0.03%

中信建投中证500增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.55%	0.76%	1.12%	0.69%	2.43%	0.07%
过去三个月	10.78%	0.67%	8.41%	0.65%	2.37%	0.02%
过去六个月	15.92%	0.93%	6.61%	0.94%	9.31%	-0.01%
过去一年	37.77%	1.24%	15.35%	1.19%	22.42%	0.05%
自基金合同 生效起至今	51.02%	1.18%	22.45%	1.15%	28.57%	0.03%

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

中信建投中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月09日-2021年06月30日)



中信建投中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月09日-2021年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

中信建投基金积极回归公募基金业务本源，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，公司主动投资管理能力大幅提升，在2021年二季度海通证券评价报告中，中信建投基金近一年基金管理人股票投资主动管理能力排名46/141，近三年基金管理人股票投资主动管理能力排名第22/116。

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的 基金经理	2020-05-09	-	6年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限

					公司，现任本公司权益投资部指数与量化投资部负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易场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

今年上半年，随着增量入场资金，一致性上涨预期驱动大量博弈资金入场，博弈性资金退潮导致市场结构性波动有所加大，机构重仓股票在年初经历了大幅回撤。进入到二季度，随着市场对流动性及通胀预期变的乐观，市场总体走势为震荡上行。产品严格把控风险，在本报告期间获得了超越业绩比较基准的业绩。我们在依据量化模型进行股

票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证500增强A基金份额净值为1.5154元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.10%，同期业绩比较基准收益率为6.61%；截至报告期末中信建投中证500增强C基金份额净值为1.5102元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.92%，同期业绩比较基准收益率为6.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计整体经济维持稳步复苏趋势，预计下半年经济数据延续缓慢复苏，但节奏迟缓、局部信用风险事件等扰动因素也开始增多，政策依然会保持平稳，支持经济持续修复。国内宏观流动性受海外影响有限，货币政策有望继续保持平稳，权益资产的相对吸引力在多重政策引导下凸显，资本市场流动性依旧充裕。下半年板块分化抱团行情对量化产品可能会带来一定的冲击。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 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基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投中证500指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	11,733,566.34	20,735,866.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	175,597,991.96	131,755,029.87
其中：股票投资		175,597,991.96	131,755,029.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,199.96	2,691.40
应收股利		-	-
应收申购款		2,306,027.73	322,538.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		189,640,785.99	152,816,126.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,285,096.61	12,960,891.98
应付管理人报酬		104,451.68	94,531.75
应付托管费		13,926.89	12,604.24
应付销售服务费		16,559.27	16,442.22

应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	218,999.85	180,186.22
负债合计		2,639,034.30	13,264,656.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	123,576,595.72	106,996,101.26
未分配利润	6.4.7.10	63,425,155.97	32,555,368.62
所有者权益合计		187,001,751.69	139,551,469.88
负债和所有者权益总计		189,640,785.99	152,816,126.29

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额123,576,595.72份，其中A类基金份额净值1.5154元，基金份额72,914,008.16份；C类基金份额净值1.5102元，基金份额50,662,587.56份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
<b>一、收入</b>		24,023,588.94	20,432,749.86
1. 利息收入		39,036.69	227,115.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,036.69	179,860.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	47,255.52

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,282,415.59	13,092,756.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,033,013.18	12,103,154.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,249,402.41	989,602.46
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,434,664.86	6,961,424.61
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	267,471.80	151,452.50
<b>减：二、费用</b>		2,925,184.47	1,420,719.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	477,418.99	253,825.14
2. 托管费	6.4.10.2. 2	63,655.86	33,843.36
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	74,008.93	57,809.73
4. 交易费用	6.4.7.18	2,125,798.13	1,016,649.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	184,302.56	58,592.44
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		21,098,404.47	19,012,029.94

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,098,404.47	19,012,029.94

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	106,996,101.26	32,555,368.62	139,551,469.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,098,404.47	21,098,404.47
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）	16,580,494.46	9,771,382.88	26,351,877.34
其中：1. 基金申购款	116,365,340.61	46,910,319.36	163,275,659.97
2. 基金赎回款	-99,784,846.15	-37,138,936.48	-136,923,782.63
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）	123,576,595.72	63,425,155.97	187,001,751.69
项 目	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年06月30日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	272,396,616.24	-	272,396,616.24
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	19,012,029.94	19,012,029.94
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)	-130,817,465.41	-5,350,786.48	-136,168,251.89
其中: 1. 基金申购款	4,011,830.88	266,498.31	4,278,329.19
2. 基金赎回 款	-134,829,296.29	-5,617,284.79	-140,446,581.08
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)	141,579,150.83	13,661,243.46	155,240,394.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

黄凌

谭淼

谭保民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信建投中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2020〕第367号《关于准予中信建投同顺量化逆向策略股票型证券投资基金变更注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0003号验资报告予

以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年5月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为272,396,616.24份基金份额,其中认购资金利息折合146,489.89份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于90%,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年1月1日至2021年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	5,470,054.15
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	6,263,512.19
合计	11,733,566.34

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		169,735,039.64	175,597,991.96	5,862,952.32
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		169,735,039.64	175,597,991.96	5,862,952.32

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,237.19

应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	524.98
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	437.79
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	3,199.96

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	648.29
预提费用	84,302.56
其他应付	134,049.00
合计	218,999.85

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 中信建投中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----------------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,276,486.95	62,276,486.95
本期申购	52,889,816.01	52,889,816.01
本期赎回（以“-”号填列）	-42,252,294.80	-42,252,294.80
本期末	72,914,008.16	72,914,008.16

#### 6.4.7.9.2 中信建投中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,719,614.31	44,719,614.31
本期申购	63,475,524.60	63,475,524.60
本期赎回（以“-”号填列）	-57,532,551.35	-57,532,551.35
本期末	50,662,587.56	50,662,587.56

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中信建投中证500增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,238,436.03	-1,223,577.22	19,014,858.81
本期利润	10,112,628.91	3,154,716.13	13,267,345.04
本期基金份额交易产生的变动数	6,463,815.72	-1,167,328.19	5,296,487.53
其中：基金申购款	22,363,225.43	-1,464,794.13	20,898,431.30
基金赎回款	-15,899,409.71	297,465.94	-15,601,943.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,814,880.66	763,810.72	37,578,691.38

#### 6.4.7.10.2 中信建投中证500增强C

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,418,018.65	-877,508.84	13,540,509.81
本期利润	6,551,110.70	1,279,948.73	7,831,059.43
本期基金份额交易产生的变动数	4,350,571.68	124,323.67	4,474,895.35
其中：基金申购款	26,739,376.68	-727,488.62	26,011,888.06
基金赎回款	-22,388,805.00	851,812.29	-21,536,992.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,319,701.03	526,763.56	25,846,464.59

#### 6.4.7.11 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06月30日
活期存款利息收入	30,234.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,363.68
结算备付金利息收入	-
其他	438.17
合计	39,036.69

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	781,967,169.27
减：卖出股票成本总额	763,934,156.09
买卖股票差价收入	18,033,013.18

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,249,402.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,249,402.41

#### 6.4.7.16 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06月30日
1. 交易性金融资产	4,434,664.86
——股票投资	4,434,664.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,434,664.86

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	267,471.80
合计	267,471.80

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,125,798.13
银行间市场交易费用	-
合计	2,125,798.13

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
指数使用费	100,000.00
合计	184,302.56

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

经基金管理人股东会2020年度第四次临时会议决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可（2021）1012号文批准，本公司股东江苏广传广播传媒有限公司将其持有的本公司20%的股权转让给中信建投证券股份有限公司。于2021年4月9日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，基金管理人股权结构为：中信建投证券股份有限公司75%，航天科技财务有限责任公司25%。上述事项基金管理人已于2021年4月10日在证监会规定媒介披露。

除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的原股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日） 至2020年06月30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
中信证券 股份有限	1,582,826,799.54	100.00%	755,704,922.70	100.00%

公司				
----	--	--	--	--

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日） 至2020年06月30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
中信证券 股份有限 公司	-	-	648,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信证券 股份有限 公司	1,198,018.88	100.00%	-	-
关联方名	上年度可比期间			

称	2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	635,507.80	100.00%	-	-

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	477,418.99	253,825.14
其中：支付销售机构的客户维护费	195,794.20	124,568.69

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	63,655.86	33,843.36

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	1,657.24	1,657.24
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	6,215.53	6,215.53
中信证券 股份有限 公司	0.00	52,621.61	52,621.61
合计	-	60,494.38	60,494.38
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	65.55	65.55
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	645.62	645.62
中信证券 股份有限 公司	0.00	53,485.78	53,485.78

合计	-	54,196.95	54,196.95
----	---	-----------	-----------

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

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值×0.30%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 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06月30日		上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司-证券户	6,263,512.19	8,363.68	8,026,995.84	14,328.46

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日				
关联	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

方名 称				数量（单位： 张/股）	总金额
中信 建投 证券 股份 有限 公司	605305	中际联合	网下配售	368	13,961.92
中信 建投 证券 股份 有限 公司	603511	爱慕股份	网下配售	553	11,607.47
中信 建投 证券 股份 有限 公司	688625	呈和科技	网下配售	2,297	37,854.56
中信 证券 股份 有限 公司	688819	天能股份	网下配售	2,554	106,731.66
中信 证券 股份 有限 公司	605060	联德股份	网下配售	883	13,765.97
中信 证券 股份 有限	688575	亚辉龙	网下配售	2,199	32,545.20

公司					
中信证券股份有限公司	300993	玉马遮阳	网下配售	4,097	49,573.70
中信证券股份有限公司	688425	铁建重工	网下配售	20,370	58,461.90
中信证券股份有限公司	688226	威腾电气	网下配售	2,693	17,289.06

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	科创板打新限售	2.87	4.75	20,370	58,461.90	96,757.50	-

688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,356	52,680.60	52,680.60	-
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	科创板打新限售	36.65	32.39	1,494	54,755.10	48,390.66	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打新限售	12.54	27.89	473	5,931.42	13,191.97	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-	2021-12-	创业板打	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.8	-

		21	29	新限售					1	
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.38	289	3,687.64	12,536.82	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	286	7,061.34	9,069.06	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.94	168	3,580.08	8,389.92	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-	2021-11-	创业板打	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

		17	24	新限售						
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	创业板打新限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	24.81	159	3,959.10	3,944.79	-

301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
--------	------	------------	------------	---------	------	------	-----	----------	----------	---

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

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

#### 6.4.12.2 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
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	10,700	497,135.64	602,945.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年6月30日，本基金无债券投资（2020年12月31日：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2021年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

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

现价值。于2021年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,733,566.34	-	-	-	11,733,566.34
交易性金融资产	-	-	-	175,597,991.96	175,597,991.96
应收利息	-	-	-	3,199.96	3,199.96

应收申购款	-	-	-	2,306,027.73	2,306,027.73
资产总计	11,733,566.34	-	-	177,907,219.65	189,640,785.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,285,096.61	2,285,096.61
应付管理人报酬	-	-	-	104,451.68	104,451.68
应付托管费	-	-	-	13,926.89	13,926.89
应付销售服务费	-	-	-	16,559.27	16,559.27
其他负债	-	-	-	218,999.85	218,999.85
负债总计	-	-	-	2,639,034.30	2,639,034.30
利率敏感度缺口	11,733,566.34	-	-	175,268,185.35	187,001,751.69
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	20,735,866.60	-	-	-	20,735,866.60
交易性金融资产	-	-	-	131,755,029.87	131,755,029.87
应收利息	-	-	-	2,691.40	2,691.40
应收申购款	-	-	-	322,538.42	322,538.42
资产总计	20,735,866.60	-	-	132,080,259.69	152,816,126.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,960,891.98	12,960,891.98
应付管理人报酬	-	-	-	94,531.75	94,531.75
应付托	-	-	-	12,604.24	12,604.24

管费					
应付销售服务费	-	-	-	16,442.22	16,442.22
其他负债	-	-	-	180,186.22	180,186.22
负债总计	-	-	-	13,264,656.41	13,264,656.41
利率敏感度缺口	20,735,866.60	-	-	118,815,603.28	139,551,469.88

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2020年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30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	175,597,991.96	93.90	131,755,029.87	94.41
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	175,597,991.96	93.90	131,755,029.87	94.41

#### 6.4.13.4.3.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	8,918,899.18	6,740,586.34
	业绩比较基准下降5%	-8,918,899.18	-6,740,586.34

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为174,487,679.47元，属于第二层次的余额为1,110,312.49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130,539,520.08元，属于第二层次的余额为1,215,509.79元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	175,597,991.96	92.60

	其中：股票	175,597,991.96	92.60
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	11,733,566.34	6.19
8	其他各项资产	2,309,227.69	1.22
9	合计	189,640,785.99	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	348,648.00	0.19
B	采矿业	7,238,801.00	3.87
C	制造业	95,370,237.68	51.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,527,811.00	1.89
E	建筑业	1,477,731.00	0.79
F	批发和零售业	5,621,068.00	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,103,834.00	2.73
H	住宿和餐饮业	495,465.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,649,830.00	5.16
J	金融业	6,179,323.00	3.30
K	房地产业	7,263,381.00	3.88

L	租赁和商务服务业	1,385,874.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	195,075.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,478,003.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	630,068.60	0.34
Q	卫生和社会工作	1,049,420.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	3,851,402.00	2.06
S	综合	347,130.00	0.19
	合计	151,213,102.28	80.86

### 7.2.2 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	625,487.00	0.33
C	制造业	16,292,898.11	8.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	434,241.74	0.23
E	建筑业	881,940.44	0.47
F	批发和零售业	901,349.14	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	606,574.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,807,584.60	0.97
J	金融业	807,344.00	0.43
K	房地产业	490,425.00	0.26
L	租赁和商务服务业	449,754.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	471,638.65	0.25

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	615,653.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	24,384,889.68	13.04

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	601636	旗滨集团	93,200	1,729,792.00	0.93
2	601699	潞安环能	145,800	1,721,898.00	0.92
3	601233	桐昆股份	70,500	1,698,345.00	0.91
4	600500	中化国际	215,600	1,694,616.00	0.91
5	603156	养元饮品	59,000	1,686,220.00	0.90
6	600884	杉杉股份	71,600	1,669,712.00	0.89
7	600141	兴发集团	87,400	1,645,742.00	0.88
8	603355	莱克电气	25,100	1,561,973.00	0.84
9	600808	马钢股份	348,600	1,495,494.00	0.80
10	601689	拓普集团	39,600	1,482,228.00	0.79
11	601928	凤凰传媒	200,500	1,431,570.00	0.77
12	601598	中国外运	281,500	1,421,575.00	0.76
13	600039	四川路桥	215,500	1,351,185.00	0.72
14	600782	新钢股份	229,500	1,280,610.00	0.68

15	600642	申能股份	206,000	1,264,840.00	0.68
16	603885	吉祥航空	81,700	1,246,742.00	0.67
17	002648	卫星石化	31,300	1,226,647.00	0.66
18	601828	美凯龙	102,000	1,224,000.00	0.65
19	000983	山西焦煤	146,100	1,214,091.00	0.65
20	600623	华谊集团	137,800	1,214,018.00	0.65
21	300316	晶盛机电	24,000	1,212,000.00	0.65
22	002572	索菲亚	50,000	1,210,000.00	0.65
23	603256	宏和科技	125,000	1,142,500.00	0.61
24	000898	鞍钢股份	250,500	1,114,725.00	0.60
25	002946	新乳业	73,000	1,105,950.00	0.59
26	300168	万达信息	75,000	1,095,000.00	0.59
27	300630	普利制药	20,700	1,084,680.00	0.58
28	601098	中南传媒	122,500	1,080,450.00	0.58
29	000830	鲁西化工	57,100	1,069,483.00	0.57
30	601869	长飞光纤	43,800	1,066,968.00	0.57
31	002382	蓝帆医疗	50,600	1,055,010.00	0.56
32	300244	迪安诊断	27,400	1,049,420.00	0.56
33	600282	南钢股份	292,200	1,040,232.00	0.56
34	000062	深圳华强	61,500	1,039,965.00	0.56
35	002557	洽洽食品	23,900	1,030,090.00	0.55
36	002532	天山铝业	120,200	1,008,478.00	0.54
37	603260	合盛硅业	13,100	1,007,521.00	0.54
38	600901	江苏租赁	193,200	1,004,640.00	0.54
39	002422	科伦药业	50,200	1,001,490.00	0.54
40	000732	泰禾集团	455,000	982,800.00	0.53
41	000012	南玻 A	94,300	965,632.00	0.52
42	600348	阳泉煤业	128,700	954,954.00	0.51
43	002745	木林森	69,900	936,660.00	0.50
44	603638	艾迪精密	21,600	925,992.00	0.50
45	600390	五矿资本	153,500	917,930.00	0.49

46	600008	首创股份	303,800	914,438.00	0.49
47	600038	中直股份	17,200	907,128.00	0.49
48	300741	华宝股份	17,800	902,816.00	0.48
49	600373	中文传媒	90,000	887,400.00	0.47
50	300463	迈克生物	21,000	883,890.00	0.47
51	300618	寒锐钴业	11,200	883,008.00	0.47
52	603589	口子窖	13,000	879,970.00	0.47
53	603225	新凤鸣	43,100	874,930.00	0.47
54	002268	卫 士 通	44,800	872,704.00	0.47
55	001914	招商积余	50,500	867,590.00	0.46
56	003022	联泓新科	27,900	856,530.00	0.46
57	300271	华宇软件	44,400	854,700.00	0.46
58	002078	太阳纸业	63,900	853,065.00	0.46
59	603712	七一二	23,600	851,960.00	0.46
60	000869	张 裕 A	22,800	846,792.00	0.45
61	600376	首开股份	151,200	846,720.00	0.45
62	600885	宏发股份	13,500	846,450.00	0.45
63	002416	爱施德	84,200	844,526.00	0.45
64	002511	中顺洁柔	30,500	840,275.00	0.45
65	002028	思源电气	27,100	834,409.00	0.45
66	603568	伟明环保	36,500	833,295.00	0.45
67	601139	深圳燃气	126,100	827,216.00	0.44
68	601577	长沙银行	91,300	816,222.00	0.44
69	300474	景嘉微	8,300	812,736.00	0.43
70	300699	光威复材	10,700	812,665.00	0.43
71	002110	三钢闽光	119,700	806,778.00	0.43
72	002408	齐翔腾达	64,300	798,606.00	0.43
73	603737	三棵树	4,500	792,000.00	0.42
74	601512	中新集团	79,300	789,828.00	0.42
75	002281	光迅科技	32,000	787,200.00	0.42
76	000887	中鼎股份	65,100	786,408.00	0.42

77	000501	鄂武商 A	66,600	779,220.00	0.42
78	002653	海思科	35,900	772,568.00	0.41
79	603927	中科软	17,800	764,510.00	0.41
80	002926	华西证券	79,200	762,696.00	0.41
81	000039	中集集团	41,500	754,470.00	0.40
82	002048	宁波华翔	38,600	752,700.00	0.40
83	002368	太极股份	36,900	740,214.00	0.40
84	000959	首钢股份	131,600	739,592.00	0.40
85	002138	顺络电子	18,800	728,876.00	0.39
86	002396	星网锐捷	33,700	719,495.00	0.38
87	601168	西部矿业	59,200	706,256.00	0.38
88	000960	锡业股份	43,800	702,114.00	0.38
89	300072	三聚环保	120,200	689,948.00	0.37
90	002390	信邦制药	65,700	688,536.00	0.37
91	600755	厦门国贸	83,000	681,430.00	0.36
92	600549	厦门钨业	32,700	681,141.00	0.36
93	600188	兖州煤业	44,100	677,376.00	0.36
94	603719	良品铺子	15,000	675,000.00	0.36
95	600862	中航高科	21,700	667,926.00	0.36
96	002080	中材科技	25,500	667,335.00	0.36
97	002507	涪陵榨菜	17,700	666,582.00	0.36
98	002867	周大生	33,500	662,295.00	0.35
99	000807	云铝股份	55,200	656,880.00	0.35
100	600563	法拉电子	4,100	649,276.00	0.35
101	002244	滨江集团	154,900	649,031.00	0.35
102	600350	山东高速	105,400	648,210.00	0.35
103	000988	华工科技	27,500	646,800.00	0.35
104	002266	浙富控股	129,200	644,708.00	0.34
105	600315	上海家化	10,700	643,498.00	0.34
106	002128	露天煤业	61,000	635,010.00	0.34
107	300166	东方国信	51,200	632,832.00	0.34

108	603377	东方时尚	58,940	630,068.60	0.34
109	002212	天融信	31,400	620,778.00	0.33
110	002387	维信诺	59,500	620,585.00	0.33
111	600739	辽宁成大	29,500	613,895.00	0.33
112	600398	海澜之家	83,500	604,540.00	0.32
113	600329	中新药业	21,500	603,935.00	0.32
114	600460	士兰微	10,700	602,945.00	0.32
115	300146	汤臣倍健	18,100	595,490.00	0.32
116	002603	以岭药业	20,300	591,948.00	0.32
117	002439	启明星辰	20,300	588,903.00	0.31
118	000513	丽珠集团	11,700	585,234.00	0.31
119	002250	联化科技	20,800	580,320.00	0.31
120	002444	巨星科技	17,000	579,360.00	0.31
121	300207	欣旺达	17,700	576,312.00	0.31
122	002985	北摩高科	5,900	575,250.00	0.31
123	002966	苏州银行	77,700	571,095.00	0.31
124	300357	我武生物	8,900	570,668.00	0.31
125	000739	普洛药业	19,300	567,420.00	0.30
126	002056	横店东磁	43,200	561,600.00	0.30
127	603786	科博达	7,400	558,700.00	0.30
128	603228	景旺电子	21,000	550,200.00	0.29
129	300482	万孚生物	8,500	549,865.00	0.29
130	000402	金融街	81,300	548,775.00	0.29
131	002180	纳思达	16,600	534,520.00	0.29
132	600325	华发股份	79,200	533,808.00	0.29
133	600377	宁沪高速	54,500	531,920.00	0.28
134	002563	森马服饰	44,400	530,580.00	0.28
135	002925	盈趣科技	13,600	529,176.00	0.28
136	000825	太钢不锈	68,900	516,061.00	0.28
137	600895	张江高科	28,000	511,560.00	0.27
138	000050	深天马 A	35,700	506,226.00	0.27

139	002901	大博医疗	6,900	502,941.00	0.27
140	600765	中航重机	22,100	500,565.00	0.27
141	600663	陆家嘴	37,400	498,168.00	0.27
142	600089	特变电工	38,700	497,295.00	0.27
143	603707	健友股份	11,900	496,825.00	0.27
144	600754	锦江酒店	8,700	495,465.00	0.26
145	603883	老百姓	9,400	495,192.00	0.26
146	600060	海信视像	29,300	495,170.00	0.26
147	601198	东兴证券	45,200	494,036.00	0.26
148	600998	九州通	32,000	491,840.00	0.26
149	603198	迎驾贡酒	11,100	491,730.00	0.26
150	002683	宏大爆破	17,700	491,529.00	0.26
151	600160	巨化股份	55,600	491,504.00	0.26
152	601568	北元集团	57,400	491,344.00	0.26
153	601298	青岛港	79,500	491,310.00	0.26
154	300383	光环新网	34,100	490,699.00	0.26
155	600733	北汽蓝谷	36,400	490,672.00	0.26
156	688088	虹软科技	8,800	490,600.00	0.26
157	600985	淮北矿业	40,100	489,621.00	0.26
158	603893	瑞芯微	3,500	488,110.00	0.26
159	688208	道通科技	5,600	487,144.00	0.26
160	600803	新奥股份	29,500	487,045.00	0.26
161	603866	桃李面包	15,500	483,600.00	0.26
162	000581	威孚高科	23,200	483,256.00	0.26
163	000686	东北证券	55,200	466,440.00	0.25
164	002185	华天科技	30,300	466,317.00	0.25
165	002701	奥瑞金	89,700	461,058.00	0.25
166	000961	中南建设	77,300	457,616.00	0.24
167	002092	中泰化学	44,500	457,015.00	0.24
168	002203	海亮股份	42,800	455,392.00	0.24
169	000999	华润三九	15,800	422,650.00	0.23

170	002353	杰瑞股份	9,100	406,770.00	0.22
171	002690	美亚光电	7,100	395,896.00	0.21
172	603056	德邦股份	35,500	390,145.00	0.21
173	300251	光线传媒	35,000	378,350.00	0.20
174	001872	招商港口	22,100	373,932.00	0.20
175	002625	光启技术	17,500	364,175.00	0.19
176	300037	新宙邦	3,600	360,360.00	0.19
177	002074	国轩高科	8,200	357,192.00	0.19
178	300009	安科生物	23,900	356,110.00	0.19
179	002065	东华软件	44,600	353,678.00	0.19
180	300223	北京君正	3,500	353,220.00	0.19
181	002670	国盛金控	31,000	353,090.00	0.19
182	300253	卫宁健康	21,700	353,059.00	0.19
183	002294	信立泰	10,700	352,030.00	0.19
184	300308	中际旭创	9,134	351,841.68	0.19
185	002372	伟星新材	17,000	351,390.00	0.19
186	002423	中粮资本	38,800	351,140.00	0.19
187	300285	国瓷材料	7,200	351,000.00	0.19
188	002223	鱼跃医疗	9,200	350,796.00	0.19
189	002373	千方科技	21,000	350,700.00	0.19
190	000636	风华高科	11,600	350,552.00	0.19
191	002831	裕同科技	11,800	350,342.00	0.19
192	000738	航发控制	16,800	349,944.00	0.19
193	000932	华菱钢铁	53,000	349,800.00	0.19
194	002595	豪迈科技	13,100	349,770.00	0.19
195	002705	新宝股份	13,300	349,125.00	0.19
196	002191	劲嘉股份	32,800	348,992.00	0.19
197	002299	圣农发展	14,600	348,648.00	0.19
198	002429	兆驰股份	57,400	348,418.00	0.19
199	000975	银泰黄金	36,600	348,066.00	0.19
200	000009	中国宝安	19,000	347,130.00	0.19

201	002174	游族网络	20,000	343,400.00	0.18
202	002156	通富微电	14,200	341,368.00	0.18
203	000046	泛海控股	141,100	324,530.00	0.17
204	601003	柳钢股份	51,700	305,030.00	0.16
205	603888	新华网	14,300	302,731.00	0.16
206	600718	东软集团	30,200	295,356.00	0.16
207	600409	三友化工	28,400	287,124.00	0.15
208	600266	城建发展	55,400	262,596.00	0.14
209	300002	神州泰岳	49,200	238,620.00	0.13
210	600649	城投控股	48,100	228,956.00	0.12
211	600446	金证股份	15,500	223,820.00	0.12
212	600645	中源协和	8,500	195,075.00	0.10
213	002183	怡亚通	27,300	156,429.00	0.08
214	600779	水井坊	1,200	151,620.00	0.08
215	600970	中材国际	13,800	126,546.00	0.07
216	002839	张家港行	21,600	117,504.00	0.06
217	002434	万里扬	13,200	107,052.00	0.06
218	000031	大悦城	22,200	79,920.00	0.04
219	601801	皖新传媒	15,600	73,632.00	0.04
220	000528	柳工	8,600	70,520.00	0.04
221	002317	众生药业	6,000	51,660.00	0.03
222	300113	顺网科技	2,900	37,526.00	0.02
223	000685	中山公用	4,200	34,272.00	0.02
224	002815	崇达技术	1,700	21,216.00	0.01
225	000970	中科三环	1,300	12,415.00	0.01
226	600582	天地科技	2,700	10,530.00	0.01
227	300058	蓝色光标	900	5,445.00	0.00
228	600823	世茂股份	1,100	4,444.00	0.00
229	000537	广宇发展	300	1,569.00	0.00

### 7.3.2 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	603098	森特股份	14,400	560,160.00	0.30
2	601838	成都银行	33,900	428,496.00	0.23
3	603039	泛微网络	5,900	392,645.00	0.21
4	603236	移远通信	2,300	392,403.00	0.21
5	603613	国联股份	3,200	319,904.00	0.17
6	603489	八方股份	1,349	318,876.62	0.17
7	603658	安图生物	4,200	318,234.00	0.17
8	603392	万泰生物	1,200	311,016.00	0.17
9	300457	赢合科技	13,900	276,054.00	0.15
10	300413	芒果超媒	4,000	274,400.00	0.15
11	603416	信捷电气	4,300	272,921.00	0.15
12	603659	璞泰来	1,900	259,540.00	0.14
13	603279	景津环保	11,600	257,056.00	0.14
14	603583	捷昌驱动	5,000	253,100.00	0.14
15	300369	绿盟科技	15,800	252,010.00	0.13
16	301015	N百洋	4,614	251,115.78	0.13
17	002738	中矿资源	5,500	244,200.00	0.13
18	002756	永兴材料	4,100	243,499.00	0.13
19	603267	鸿远电子	1,800	230,256.00	0.12
20	300294	博雅生物	6,300	227,745.00	0.12
21	002850	科达利	2,600	227,240.00	0.12
22	300671	富满电子	1,700	223,788.00	0.12
23	603068	博通集成	2,700	222,210.00	0.12
24	601231	环旭电子	12,100	203,401.00	0.11
25	603348	文灿股份	5,800	203,000.00	0.11
26	603305	旭升股份	6,000	202,380.00	0.11

27	603187	海容冷链	4,700	201,536.00	0.11
28	603960	克来机电	5,876	194,495.60	0.10
29	002858	力盛赛车	10,300	187,563.00	0.10
30	605168	三人行	1,200	184,032.00	0.10
31	603223	恒通股份	6,200	183,706.00	0.10
32	300408	三环集团	4,300	182,406.00	0.10
33	601155	新城控股	4,300	178,880.00	0.10
34	002402	和而泰	7,000	167,790.00	0.09
35	600587	新华医疗	7,000	158,550.00	0.08
36	603008	喜临门	4,800	158,448.00	0.08
37	600845	宝信软件	3,100	157,790.00	0.08
38	600298	安琪酵母	2,900	157,702.00	0.08
39	603100	川仪股份	9,000	157,590.00	0.08
40	601666	平煤股份	22,100	157,131.00	0.08
41	601857	中国石油	29,700	157,113.00	0.08
42	603043	广州酒家	6,100	156,892.00	0.08
43	600688	上海石化	41,700	156,792.00	0.08
44	600976	健民集团	2,700	156,600.00	0.08
45	603599	广信股份	5,200	156,416.00	0.08
46	603128	华贸物流	11,100	156,399.00	0.08
47	603612	索通发展	8,700	156,339.00	0.08
48	601827	三峰环境	16,500	156,255.00	0.08
49	600684	珠江实业	42,800	156,220.00	0.08
50	601311	骆驼股份	13,500	156,195.00	0.08
51	600028	中国石化	35,800	156,088.00	0.08
52	601186	中国铁建	21,000	156,030.00	0.08
53	600104	上汽集团	7,100	155,987.00	0.08
54	601211	国泰君安	9,100	155,974.00	0.08
55	605018	长华股份	11,800	155,878.00	0.08
56	600019	宝钢股份	20,400	155,856.00	0.08
57	600438	通威股份	3,600	155,772.00	0.08

58	601339	百隆东方	28,900	155,771.00	0.08
59	601919	中远海控	5,100	155,754.00	0.08
60	600873	梅花生物	27,800	155,680.00	0.08
61	600057	厦门象屿	24,900	155,625.00	0.08
62	600293	三峡新材	53,100	155,583.00	0.08
63	601882	海天精工	10,000	155,500.00	0.08
64	600606	绿地控股	28,500	155,325.00	0.08
65	600483	福能股份	14,800	155,252.00	0.08
66	603678	火炬电子	2,300	155,250.00	0.08
67	601898	中煤能源	21,700	155,155.00	0.08
68	603606	东方电缆	7,700	155,078.00	0.08
69	603566	普莱柯	6,800	155,040.00	0.08
69	600475	华光环能	15,200	155,040.00	0.08
71	603588	高能环境	10,700	154,936.00	0.08
72	603982	泉峰汽车	9,200	154,928.00	0.08
73	600795	国电电力	63,745	154,900.35	0.08
74	600426	华鲁恒升	5,000	154,750.00	0.08
75	600512	腾达建设	50,900	154,736.00	0.08
76	600887	伊利股份	4,200	154,686.00	0.08
77	603816	顾家家居	2,000	154,560.00	0.08
78	600096	云天化	11,000	154,440.00	0.08
79	601607	上海医药	7,300	154,249.00	0.08
80	601678	滨化股份	19,500	154,245.00	0.08
81	600596	新安股份	8,700	154,164.00	0.08
82	603466	风语筑	9,400	153,690.00	0.08
83	603801	志邦家居	4,800	153,408.00	0.08
84	603186	华正新材	4,200	153,132.00	0.08
85	600966	博汇纸业	11,700	152,685.00	0.08
86	002891	中宠股份	3,700	151,700.00	0.08
87	002801	微光股份	5,400	144,882.00	0.08
88	603987	康德莱	5,500	143,000.00	0.08

89	603596	伯特利	3,900	139,425.00	0.07
90	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.07
91	603010	万盛股份	6,000	125,820.00	0.07
92	300193	佳士科技	7,800	124,176.00	0.07
93	002810	山东赫达	2,600	122,616.00	0.07
94	000858	五 粮 液	400	119,156.00	0.06
95	002230	科大讯飞	1,700	114,886.00	0.06
96	002747	埃斯顿	2,900	113,245.00	0.06
97	000063	中兴通讯	3,400	112,982.00	0.06
98	300726	宏达电子	1,600	112,784.00	0.06
99	002727	一心堂	3,400	112,574.00	0.06
100	300377	赢时胜	10,100	112,514.00	0.06
101	300035	中科电气	4,600	112,470.00	0.06
102	000933	神火股份	11,900	112,455.00	0.06
103	002833	弘亚数控	2,900	112,375.00	0.06
104	688696	极米科技	135	112,320.00	0.06
105	003025	思进智能	3,700	112,295.00	0.06
106	000776	广发证券	7,400	112,036.00	0.06
107	000949	新乡化纤	13,200	111,804.00	0.06
108	300415	伊之密	5,200	111,800.00	0.06
109	000059	华锦股份	13,700	111,792.00	0.06
110	300196	长海股份	6,500	111,540.00	0.06
111	002139	拓邦股份	6,200	111,538.00	0.06
112	002677	浙江美大	6,100	111,508.00	0.06
113	003012	东鹏控股	6,700	111,488.00	0.06
114	003006	百亚股份	4,700	111,390.00	0.06
115	002293	罗莱生活	8,300	111,137.00	0.06
116	000725	京东方 A	17,800	111,072.00	0.06
117	002015	协鑫能科	12,300	111,069.00	0.06
118	002022	科华生物	6,200	111,042.00	0.06
119	002258	利尔化学	4,300	110,940.00	0.06

120	000001	平安银行	4,900	110,838.00	0.06
121	002274	华昌化工	11,000	110,770.00	0.06
122	000507	珠海港	18,300	110,715.00	0.06
123	002430	杭氧股份	3,200	110,688.00	0.06
124	000683	远兴能源	23,700	110,679.00	0.06
125	002601	龙鳞佰利	3,200	110,656.00	0.06
126	002179	中航光电	1,400	110,628.00	0.06
127	002521	齐峰新材	17,000	110,500.00	0.06
128	003016	欣贺股份	6,900	110,469.00	0.06
129	002636	金安国纪	6,800	110,296.00	0.06
130	002027	分众传媒	11,700	110,097.00	0.06
131	002763	汇洁股份	11,600	110,084.00	0.06
132	300737	科顺股份	3,500	110,040.00	0.06
132	002345	潮宏基	21,000	110,040.00	0.06
134	300587	天铁股份	4,900	110,005.00	0.06
135	002876	三利谱	1,700	109,990.00	0.06
136	000733	振华科技	1,800	109,926.00	0.06
137	002329	皇氏集团	21,700	109,585.00	0.06
138	300219	鸿利智汇	8,300	109,560.00	0.06
139	002064	华峰化学	7,700	109,340.00	0.06
140	002614	奥佳华	4,800	108,624.00	0.06
141	002932	明德生物	1,100	107,327.00	0.06
142	300750	宁德时代	200	106,960.00	0.06
143	002624	完美世界	4,400	105,204.00	0.06
144	300769	德方纳米	500	103,345.00	0.06
145	300379	东方通	3,400	96,866.00	0.05
146	688425	铁建重工	20,370	96,757.50	0.05
147	300811	铂科新材	1,600	84,352.00	0.05
148	688560	明冠新材	3,136	75,577.60	0.04
149	002975	博杰股份	700	61,600.00	0.03
150	688499	利元亨	1,356	52,680.60	0.03

151	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
152	688669	聚石化学	1,494	48,390.66	0.03
153	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
154	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
155	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
156	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
157	301009	可靠股份	473	13,191.97	0.01
158	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
159	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.01
160	300940	南极光	289	12,536.82	0.01
161	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
162	300925	法本信息	432	11,357.28	0.01
163	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
164	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
165	300932	三友联众	286	9,069.06	0.00
166	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
167	300941	创识科技	168	8,389.92	0.00
168	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
169	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
170	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
171	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
172	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
173	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
174	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
175	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
176	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
177	300985	致远新能	159	3,944.79	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	603256	宏和科技	4,258,105.00	3.05
2	600282	南钢股份	4,126,337.00	2.96
3	000501	鄂武商 A	3,977,410.00	2.85
4	600053	九鼎投资	3,685,778.91	2.64
5	002174	游族网络	3,603,262.00	2.58
6	600782	新钢股份	3,446,722.25	2.47
7	002382	蓝帆医疗	3,316,516.24	2.38
8	000983	山西焦煤	3,302,741.00	2.37
9	002946	新乳业	3,011,446.00	2.16
10	600398	海澜之家	3,000,869.00	2.15
11	002572	索菲亚	2,947,155.16	2.11
12	000830	鲁西化工	2,934,731.00	2.10
13	603589	口子窖	2,884,254.56	2.07
14	000999	华润三九	2,863,811.00	2.05
15	600808	马钢股份	2,859,562.76	2.05
16	300166	东方国信	2,857,766.00	2.05
17	600039	四川路桥	2,853,824.00	2.04
18	600985	淮北矿业	2,822,807.00	2.02
19	600348	阳泉煤业	2,811,224.00	2.01
20	600373	中文传媒	2,801,991.00	2.01
21	002408	齐翔腾达	2,794,246.00	2.00
22	000807	云铝股份	2,791,057.00	2.00

### 7.4.2 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	600053	九鼎投资	4,241,886.16	3.04
2	000501	鄂武商 A	3,498,806.82	2.51
3	601966	玲珑轮胎	3,414,764.65	2.45
4	300324	旋极信息	3,414,558.00	2.45
5	002174	游族网络	3,401,737.00	2.44
6	000807	云铝股份	3,240,167.00	2.32
7	603256	宏和科技	3,179,956.00	2.28
8	600779	水井坊	3,140,000.00	2.25
9	600409	三友化工	3,024,392.00	2.17
10	600282	南钢股份	3,015,417.00	2.16
11	603806	福斯特	3,014,882.00	2.16
12	688321	微芯生物	2,957,888.48	2.12
13	600507	方大特钢	2,923,336.74	2.09
14	603260	合盛硅业	2,843,044.00	2.04
15	300182	捷成股份	2,834,243.00	2.03
16	000932	华菱钢铁	2,833,771.00	2.03
17	600580	卧龙电驱	2,820,268.00	2.02
18	002382	蓝帆医疗	2,799,584.48	2.01
19	600704	物产中大	2,783,470.00	1.99
20	000488	晨鸣纸业	2,751,789.00	1.97

#### 7.4.3 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	803,342,453.32
卖出股票收入（成交）总额	781,967,169.27

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,199.96
5	应收申购款	2,306,027.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,309,227.69

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无余额。

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

无余额。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
中信 建投 中证5 00增 强A	2,319	31,442.00	23,777,349.18	32.6101%	49,136,658.98	67.3899%
中信 建投 中证5 00增 强C	3,973	12,751.72	12,967,024.19	25.5949%	37,695,563.37	74.4051%
合计	6,214	19,886.80	36,744,373.37	29.7341%	86,832,222.35	70.2659%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投中证500增强A	74,738.28	0.1025%
	中信建投中证500增强C	47,249.76	0.0933%
	合计	121,988.04	0.0987%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
基金合同生效日(2020年05月09日)基金份额总额	109,947,302.18	162,449,314.06
本报告期期初基金份额总额	62,276,486.95	44,719,614.31
本报告期基金总申购份额	52,889,816.01	63,475,524.60
减：本报告期基金总赎回份额	42,252,294.80	57,532,551.35
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	72,914,008.16	50,662,587.56

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

## 10.2 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

2021年2月26日，黄凌先生担任基金管理人董事长、法定代表人，蒋月勤先生不再担任基金管理人董事长、法定代表人。

2021年6月11日，方俊才先生担任基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券（券商柜台）	2	1,582,826,799.54	100.00%	1,198,018.88	100.00%	-

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

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

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

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（60%）+特别研究服务（20%）+综合研究服务（20%）。基础研究服务占60%权重，由权益投资部组织投研条线相关人员进行打分；特别研究服务占20%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分；综合研究服务占20%权重，由公募产品基金经理、研究员和权益投资部行政秘书负责打分。

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

## 10.8 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	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-06
2	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-12
3	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-21
4	中信建投基金管理有限公司	规定报刊	2021-01-22

	旗下部分基金2020年第4季度报告提示性公告		
5	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2020年第4季度报告	规定网站	2021-01-22
6	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金参加基金申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-02-04
7	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-02-24
8	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-02-27
9	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-24
10	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
11	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告	规定网站	2021-03-31
12	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-31
13	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同（2021年3月）	规定网站	2021-03-31

14	中信建投中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2021-04-06
15	中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2021-04-06
16	中信建投基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-07
17	中信建投基金管理有限公司关于完成股东变更工商变更登记的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-10
18	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
19	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年第1季度报告	规定网站	2021-04-22
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-28
21	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-12
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-12
23	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-19
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联	规定报刊、规定网站	2021-05-20

	方承销证券的公告		
25	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资业务并调整申购起点金额的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-20
26	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-24
27	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-02
28	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-06-12
29	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-12
30	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加大河财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-23
31	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	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	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

者类别	号	份额比例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20210318-20210608	-	22, 103, 595. 64	-	22, 103, 595. 64	17. 8866%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日