

中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29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。

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

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	108
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	108
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	108
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	108
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	109
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	109

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	109
8.12 投资组合报告附注.....	109
§9 基金份额持有人信息.....	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	110
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	110
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.....	111
§10 开放式基金份额变动.....	111
§11 重大事件揭示.....	111
11.1 基金份额持有人大会决议.....	111
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.....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	112
11.4 基金投资策略的改变.....	112
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	112
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	112
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	112
11.8 其他重大事件.....	113
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	122
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.....	122
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	122
§13 备查文件目录.....	122
13.1 备查文件目录.....	122
13.2 存放地点.....	123
13.3 查阅方式.....	123

§ 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	426,644,107.85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	193,697,880.00份	232,946,227.85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	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。 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。
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 朱伟 联系电话 010-59100208 电子邮箱 zhuweibj@csc.com.cn	杨军智 010-60834299 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	2021年		2020年05月09日（基金合同生效 日）-2020年12月31日	
	中信建投中证 500增强A	中信建投中证 500增强C	中信建投中证5 00增强A	中信建投中证5 00增强C
本期已实现收益	24,753,243.0 1	19,937,116.7 5	24,485,599.35	21,641,919.03
本期利润	33,111,517.2 8	21,823,192.3 4	23,566,183.83	23,989,622.01
加权平均基金份额 额本期利润	0.3146	0.2024	0.3121	0.3330
本期加权平均净 值利润率	19.90%	12.62%	25.79%	28.37%
本期基金份额净 值增长率	29.07%	28.67%	30.53%	30.28%
3.1.2 期末数据 和指标	2021年末		2020年末	
期末可供分配利 润	125,435,541. 89	148,961,209. 28	19,014,858.81	13,540,509.81
期末可供分配基 金份额利润	0.6476	0.6395	0.3053	0.3028
期末基金资产净 值	326,313,391. 22	390,497,569. 13	81,291,345.76	58,260,124.12
期末基金份额净 值	1.6847	1.6763	1.3053	1.3028
3.1.3 累计期末 指标	2021年末		2020年末	
基金份额累计净 值增长率	68.47%	67.63%	30.53%	30.28%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投中证500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.78%	0.77%	3.43%	0.72%	-1.65%	0.05%
过去六个月	11.17%	0.97%	7.72%	0.91%	3.45%	0.06%
过去一年	29.07%	0.95%	14.83%	0.92%	14.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	68.47%	1.12%	31.90%	1.08%	36.57%	0.04%

中信建投中证500增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.70%	0.77%	3.43%	0.72%	-1.73%	0.05%
过去六个月	11.00%	0.97%	7.72%	0.91%	3.28%	0.06%
过去一年	28.67%	0.95%	14.83%	0.92%	13.84%	0.03%
自基金合同生效起至今	67.63%	1.12%	31.90%	1.08%	35.73%	0.04%

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

中信建投中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月09日-2021年12月31日)

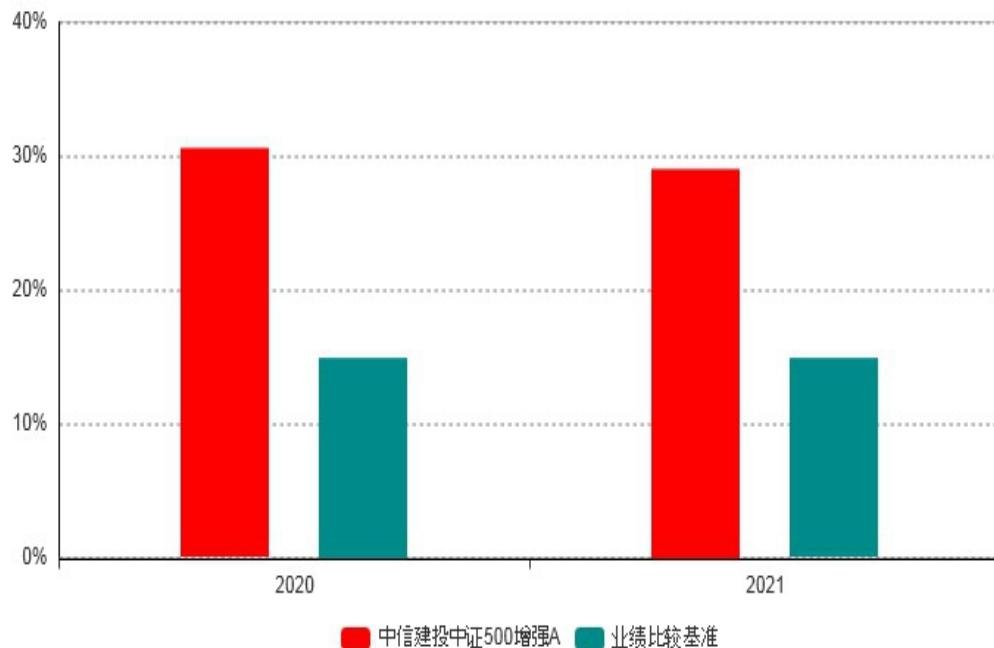


中信建投中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月09日-2021年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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。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、指数与量化投资部行政负责人	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、CIB C World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、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，曾任权益投资部指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、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、中信建投量化精选 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。进入到三季度，通胀预期持续升温，海外股市波动增大，海外地缘冲突加剧，国内散发疫情增多叠加春节效应导致多方信心不足。产品严格把控风险，在本报告期内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1.6847元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为29.07%，同期业绩比较基准收益率为14.83%；截至报告期末中信建投中证500增强C基金份额净值为1.6763元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为28.67%，同期业绩比较基准收益率为14.83%。

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2022年，我国经济中长期稳中向好的趋势没有变，各项稳增长政策措施渐次落地，货币财政等宏观政策还有很大空间，近期央行加大公开市场操作力度，市场流动性较为宽裕。经过近几年全面深化资本市场改革，A股市场内在结构已发生深刻变化，经过年前的持续大跌，估值水平已较为合理，赛道风险逐步释放，随着各大机构开始自购，稳增长带动的春季行情预计将逐步开启，持续调整的可能性不大，市场向下的空间有限。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第23049号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中信建投中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“中信建投中证500增强基金”)的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表和

	<p>所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了中信建投中证500增强基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于中信建投中证500增强基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中信建投中证500增强基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投中证500增强基金2021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。基于我们已经执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大</p>

	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。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中信建投中证500增强基金的基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投中证500增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投中证500增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投中证500增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(二) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对中信建投中证500增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中信建投中证500增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竟 郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2022-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 中信建投中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日: 2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7. 4. 7. 1	44, 726, 419. 22	20, 735, 866. 60
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	674, 161, 400. 26	131, 755, 029. 87
其中：股票投资		674, 161, 400. 26	131, 755, 029. 87
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券 投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	7. 4. 7. 4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7. 4. 7. 5	14, 531. 44	2, 691. 40
应收股利		—	—
应收申购款		1, 721, 157. 41	322, 538. 42
递延所得税资产		—	—
其他资产	7. 4. 7. 6	—	—
资产总计		720, 623, 508. 33	152, 816, 126. 29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—

应付赎回款		3,085,302.98	12,960,891.98
应付管理人报酬		463,254.59	94,531.75
应付托管费		61,767.28	12,604.24
应付销售服务费		101,236.18	16,442.22
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	100,986.95	180,186.22
负债合计		3,812,547.98	13,264,656.41
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	426,644,107.85	106,996,101.26
未分配利润	7.4.7.10	290,166,852.50	32,555,368.62
所有者权益合计		716,810,960.35	139,551,469.88
负债和所有者权益总计		720,623,508.33	152,816,126.29

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额426,644,107.85份，其中A类基金份额净值1.6847元，基金份额193,697,880.00份；C类基金份额净值1.6763元，基金份额232,946,227.85份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		69,025,197.97	57,074,237.88
1. 利息收入		247,326.66	273,548.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	247,326.66	226,293.03

债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	47,255.52
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		56,499,936.28	54,835,264.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	53,282,383.18	53,543,951.09
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	3,217,553.10	1,291,312.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	10,244,349.86	1,428,287.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,033,585.17	537,137.83
减：二、费用		14,090,488.35	9,518,432.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	2,526,144.05	845,246.41
2. 托管费	7.4.10.2. 2	336,819.21	112,699.51
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	516,831.47	162,013.62
4. 交易费用	7.4.7.18	10,340,693.62	8,138,951.62
5. 利息支出		—	—

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7. 4. 7. 19	370,000.00	259,520.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		54,934,709.62	47,555,805.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		54,934,709.62	47,555,805.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中信建投中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	54,934,709.62	54,934,709.62
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)	319,648,006.59	202,676,774.26	522,324,780.85
其中：1. 基金申购款	797,849,267.00	486,043,283.11	1,283,892,550.11
2. 基金赎回款	-478,201,260.41	-283,366,508.85	-761,567,769.26
四、本期向基金份额	-	-	-

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)	426,644,107.85	290,166,852.50	716,810,960.35
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12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权 益(基金净值)	272,396,616.24	-	272,396,616.24
二、本期经营活动 产生的基金净值 变动数(本期利 润)	-	47,555,805.84	47,555,805.84
三、本期基金份额 交易产生的基金 净值变动数(净值 减少以“-”号填 列)	-165,400,514.98	-15,000,437.22	-180,400,952.20
其中:1.基金申购 款	128,319,270.95	35,096,718.25	163,415,989.20
2.基金赎 回款	-293,719,785.93	-50,097,155.47	-343,816,941.40
四、本期向基金份 额持有人分配利 润产生的基金净 值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权 益(基金净值)	106,996,101.26	32,555,368.62	139,551,469.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄凌

谭淼

谭保民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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的相关规定)。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×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2020年05月09日(基金合同生效日)至2020年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资

产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征

因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

(2) 对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个月内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	16,491,879.86	13,751,582.22
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	28,234,539.36	6,984,284.38
合计	44,726,419.22	20,735,866.60

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年12月31日	成本	公允价值
		公允价值变动	
股票	662,488,762.94	674,161,400.26	11,672,637.32
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	662,488,762.94	674,161,400.26	11,672,637.32
项目	上年度末		

		2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		130,326,742.41	131,755,029.87	1,428,287.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		130,326,742.41	131,755,029.87	1,428,287.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	11,570.40	1,827.48
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	2,266.51	863.92
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	694.53	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	14,531.44	2,691.40

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	986.95	186.22
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	50,000.00	130,000.00
其他应付	50,000.00	50,000.00
合计	100,986.95	180,186.22

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 中信建投中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强A)	本期	
	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	295,124,497.10	295,124,497.10
本期赎回（以“-”号填列）	-163,703,104.05	-163,703,104.05
本期末	193,697,880.00	193,697,880.00

7.4.7.9.2 中信建投中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增强C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	44,719,614.31	44,719,614.31
本期申购	502,724,769.90	502,724,769.90
本期赎回（以“-”号填列）	-314,498,156.36	-314,498,156.36
本期末	232,946,227.85	232,946,227.85

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中信建投中证500增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证500增 强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,238,436.03	-1,223,577.22	19,014,858.81
本期利润	24,753,243.01	8,358,274.27	33,111,517.28
本期基金份额交易产 生的变动数	80,443,862.85	45,272.28	80,489,135.13
其中：基金申购款	171,454,643.59	6,092,900.33	177,547,543.92
基金赎回款	-91,010,780.74	-6,047,628.05	-97,058,408.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,435,541.89	7,179,969.33	132,615,511.22

7.4.7.10.2 中信建投中证500增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(中信建投中证500增强C)			
上年度末	14,418,018.65	-877,508.84	13,540,509.81
本期利润	19,937,116.75	1,886,075.59	21,823,192.34
本期基金份额交易产生的变动数	114,606,073.88	7,581,565.25	122,187,639.13
其中：基金申购款	294,726,503.94	13,769,235.25	308,495,739.19
基金赎回款	-180,120,430.06	-6,187,670.00	-186,308,100.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,961,209.28	8,590,132.00	157,551,341.28

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	205,783.98	200,102.37
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	40,847.77	26,190.66
结算备付金利息收入	-	-
其他	694.91	-
合计	247,326.66	226,293.03

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	3,772,072,378.02	1,702,997,298.04
减：卖出股票成本总额	3,718,789,994.84	1,649,453,346.95
买卖股票差价收入	53,282,383.18	53,543,951.09

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,217,553.10	1,291,312.95
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	3,217,553.10	1,291,312.95

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生 效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	10,244,349.86	1,428,287.46
——股票投资	10,244,349.86	1,428,287.46
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增	-	-

增值税		
合计	10,244,349.86	1,428,287.46

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	2,033,585.17	537,137.83
合计	2,033,585.17	537,137.83

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	10,340,693.62	8,138,951.62
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,340,693.62	8,138,951.62

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	129,120.88
账户维护费	-	400.00

合计	370,000.00	259,520.88
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的原股东
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年05月09日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		股票成 交总额 的比 例		股票成 交总额 的比 例
中信证券 股份有限 公司	8,008,595,816.58	100.00%	3,477,285,909.99	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年05月09日(基金合同生效日) 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
中信证券 股份有限 公司	-	-	648,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额
			占期末应 付佣金总 额的比 例

		例		
中信证券股份有限公司	5,829,690.30	100.00%	-	-
上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日				
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	6,113,993.88	100.00%	-	-

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,526,144.05	845,246.41
其中：支付销售机构的客户维护费	1,088,150.93	412,755.79

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	336,819.21	112,699.51

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	11,561.09	11,561.09
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	69,842.09	69,842.09
中信证券 股份有限 公司	0.00	235,358.61	235,358.61
合计	0.00	316,761.79	316,761.79
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C	合计
中信证券 股份有限 公司	0.00	150,726.76	150,726.76

公司			
中信建投证券股份有限公司	0.00	3,708.30	3,708.30
中信建投基金管理有限公司	0.00	358.06	358.06
合计	0.00	154,793.12	154,793.12

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

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值×0.30%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年05月09日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司-证券账户	28,234,539.36	40,847.77	6,984,284.38	26,190.66

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期	
				数量(单位:张/股)	总金额
中信建投证券股份有限公司	688167	炬光科技	网下配售	2,014	158,481.66
中信建投证券股份有限公司	301100	风光股份	网下配售	5,985	166,442.85
中信建投证券股份有限公司	600927	永安期货	网下配售	1,859	33,406.23
中信建投证券股份有限公司	301177	迪阿股份	网下配售	4,224	493,701.12
中信证券股份有限公司	688192	迪哲医药	网下配售	5,913	310,905.54
中信证券股份有限公司	600935	华塑股份	网下配售	4,811	18,955.34
中信证券股份有限公司	688739	成大生物	网下配售	3,211	353,210.00
中信建投证券股份有限公司	301090	华润材料	网下配售	23,890	249,650.50
中信证券股份有限公司	688280	精进电动	网下配售	19,620	270,363.60

公司					
中信证券股份有限公司	688211	中科微至	网下配售	2, 550	230, 010. 00
中信建投证券股份有限公司	688553	汇宇制药	网下配售	6, 740	261, 983. 80
中信建投证券股份有限公司	688697	纽威数控	网下配售	5, 837	44, 069. 35
中信建投证券股份有限公司	688707	振华新材	网下配售	8, 130	95, 527. 50
中信证券股份有限公司	301059	金三江	网下配售	2, 581	20, 880. 29
中信证券股份有限公司	688187	时代电气	网下配售	6, 377	200, 110. 26
中信证券股份有限公司	688776	国光电气	网下配售	1, 447	74, 433. 68
中信证券股份有限公司	301049	超越科技	网下配售	1, 954	37, 790. 36
中信证券股份有限公司	301050	雷电微力	网下配售	1, 797	108, 970. 08
中信证券股份有限公司	688766	普冉股份	网下配售	522	77, 725. 80
中信证券股份有限公司	688798	艾为电子	网下配售	1, 110	85, 003. 80

公司					
中信建投证券股份有限公司	688385	复旦微电	网下配售	8,852	55,147.96
中信建投证券股份有限公司	300774	倍杰特	网下配售	4,435	20,267.95
中信证券股份有限公司	688509	正元地信	网下配售	15,433	30,403.01
中信证券股份有限公司	688071	华依科技	网下配售	1,101	15,116.73
中信建投证券股份有限公司	1210	金房节能	网下配售	311	8,711.11
中信证券股份有限公司	301028	东亚机械	网下配售	7,329	38,916.99
中信证券股份有限公司	688305	科德数控	网下配售	1,496	16,500.88
中信证券股份有限公司	688226	威腾电气	网下配售	2,693	17,289.06
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
中信建投证券股份	603511	爱慕股份	网下配售	553	11,607.47

有限公司					
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	688575	亚辉龙	网下配售	2,199	32,545.20
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
中信证券股份有限公司	688819	天能股份	网下配售	2,554	106,731.66
上年度可比期间					
2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	688063	派能科技	网下配售	1,117	62,552.00
中信建投证券股份有限公司	688608	恒玄科技	网下配售	447	72,445.29
中信证券股份有限公司	003018	金富科技	网下配售	1,027	9,171.11

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688385	复旦微电	2021-07-27	2022-02-07	科创板打新限售	6.23	48.58	8,852	55,147.96	430,030.16	-
688303	大全能源	2021-07-15	2022-01-24	科创板打新限售	21.49	60.51	5,156	110,802.44	311,989.56	-
688210	统联精密	2021-12-20	2022-06-27	科创板打新限售	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板打新限售	60.66	96.75	662	40,156.92	64,048.50	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	116.88	116.08	423	49,440.24	49,101.84	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.74	180	10,915.20	42,253.20	-

3010 29	怡合 达	2021 -07- 14	2022 -01- 24	创业 板打 新限 售	14. 1 4	89. 8 7	462	6, 53 2. 68	41, 5 19. 9 4	-
3010 87	可孚 医疗	2021 -10- 15	2022 -04- 25	创业 板打 新限 售	93. 0 9	75. 3 4	379	35, 2 81. 1 1	28, 5 53. 8 6	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	创业 板打 新限 售	10. 4 5	11. 2 2	2, 389	24, 9 65. 0 5	26, 8 04. 5 8	-
3010 99	雅创 电子	2021 -11- 10	2022 -05- 23	创业 板打 新限 售	21. 9 9	71. 3 6	351	7, 71 8. 49	25, 0 47. 3 6	-
3011 89	奥尼 电子	2021 -12- 21	2022 -06- 28	创业 板打 新限 售	66. 1 8	56. 6 2	435	28, 7 88. 3 0	24, 6 29. 7 0	-
3011 66	优宁 维	2021 -12- 21	2022 -06- 28	创业 板打 新限 售	86. 0 6	94. 5 0	253	21, 7 73. 1 8	23, 9 08. 5 0	-
3010 69	凯盛 新材	2021 -09- 16	2022 -03- 28	创业 板打 新限 售	5. 17	44. 2 1	539	2, 78 6. 63	23, 8 29. 1 9	-
3010 96	百诚 医药	2021 -12- 13	2022 -06- 20	创业 板打 新限 售	79. 6 0	78. 5 3	272	21, 6 51. 2 0	21, 3 60. 1 6	-
3010 82	久盛 电气	2021 -10-	2022 -04-	创业 板打	15. 4 8	21. 5 3	915	14, 1 64. 2	19, 6 99. 9	-

		14	27	新限售				0	5	
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业板打 新限售	58.0 8	49.8 5	385	22,3 60.8 0	19,1 92.2 5	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	创业板打 新限售	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3011 00	风光 股份	2021 -12- 10	2022 -06- 17	创业板打 新限售	27.8 1	31.1 4	599	16,6 58.1 9	18,6 52.8 6	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	创业板打 新限售	4.17	30.9 4	587	2,44 7.79	18,1 61.7 8	-
3010 88	戎美 股份	2021 -10- 19	2022 -04- 28	创业板打 新限售	33.1 6	24.6 7	692	22,9 46.7 2	17,0 71.6 4	-
3011 18	恒光 股份	2021 -11- 09	2022 -05- 18	创业板打 新限售	22.7 0	49.0 2	315	7,15 0.50	15,4 41.3 0	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业板打 新限售	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业板打 新限售	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-

3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	10. 4 8	36. 6 8	379	3, 97 1. 92	13, 9 01. 7 2	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	创业 板打 新限 售	8. 86	23. 8 0	555	4, 91 7. 30	13, 2 09. 0 0	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	29. 2 8	32. 0 0	402	11, 7 70. 5 6	12, 8 64. 0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	10. 6 4	30. 4 4	421	4, 47 9. 44	12, 8 15. 2 4	-
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	2022 -06- 15	创业 板打 新限 售	26. 1 7	44. 8 6	285	7, 45 8. 45	12, 7 85. 1 0	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	9. 46	41. 4 3	290	2, 74 3. 40	12, 0 14. 7 0	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业 板打 新限 售	36. 3 1	35. 5 2	323	11, 7 28. 1 3	11, 4 72. 9 6	-
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 28	创业 板打 新限 售	4. 13	12. 9 6	843	3, 48 1. 59	10, 9 25. 2 8	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07-	2022 -01-	创业 板打	5. 31	13. 5 0	733	3, 89 2. 23	9, 89 5. 50	-

		12	20	新限售						
3007 74	倍杰特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	创业板打 新限售	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 40	中环海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业板打 新限售	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3010 78	孩子王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	创业板打 新限售	5.77	12.1 4	756	4,36 2.12	9,17 7.84	-
3008 14	中富电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	创业板打 新限售	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3010 30	仕净科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业板打 新限售	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3010 81	严牌股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	创业板打 新限售	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-
3010 98	金埔园林	2021 -11- 04	2022 -05- 12	创业板打 新限售	12.3 6	22.1 7	307	3,79 4.52	6,80 6.19	-
3010 33	迈普医学	2021 -07- 15	2022 -01- 26	创业板打 新限售	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-

3010 49	超越 科技	2021 -08- 17	2022 -02- 24	创业 板打 新限 售	19. 3 4	32. 9 2	196	3, 79 0. 64	6, 45 2. 32	-
3010 32	新柴 股份	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业 板打 新限 售	4. 97	12. 5 1	513	2, 54 9. 61	6, 41 7. 63	-
3010 56	森赫 股份	2021 -08- 27	2022 -03- 07	创业 板打 新限 售	3. 93	11. 0 9	572	2, 24 7. 96	6, 34 3. 48	-
3010 41	金百 泽	2021 -08- 02	2022 -02- 11	创业 板打 新限 售	7. 31	28. 2 1	215	1, 57 1. 65	6, 06 5. 15	-
3010 72	中捷 精工	2021 -09- 22	2022 -03- 29	创业 板打 新限 售	7. 46	33. 4 1	181	1, 35 0. 26	6, 04 7. 21	-
3010 36	双乐 股份	2021 -07- 21	2022 -02- 16	创业 板打 新限 售	23. 3 8	29. 9 3	200	4, 67 6. 00	5, 98 6. 00	-
3010 83	百胜 智能	2021 -10- 13	2022 -04- 21	创业 板打 新限 售	9. 08	14. 2 1	416	3, 77 7. 28	5, 91 1. 36	-
3008 54	中兰 环保	2021 -09- 08	2022 -03- 16	创业 板打 新限 售	9. 96	27. 2 9	203	2, 02 1. 88	5, 53 9. 87	-
3010 63	海锅 股份	2021 -09-	2022 -03-	创业 板打	17. 4 0	36. 1 1	153	2, 66 2. 20	5, 52 4. 83	-

		09	24	新限售						
0012 34	泰慕士	2021 -12- 31	2022 -01- 11	新股 未上 市	16. 5 3	16. 5 3	333	5, 50 4. 49	5, 50 4. 49	-
3010 38	深水 规院	2021 -07- 22	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	6. 68	20. 2 3	266	1, 77 6. 88	5, 38 1. 18	-
3010 59	金三 江	2021 -09- 03	2022 -03- 14	创业 板打 新限 售	8. 09	19. 3 0	259	2, 09 5. 31	4, 99 8. 70	-
3010 37	保立 佳	2021 -07- 21	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	14. 8 2	24. 2 6	193	2, 86 0. 26	4, 68 2. 18	-
3010 73	君亭 酒店	2021 -09- 22	2022 -03- 30	创业 板打 新限 售	12. 2 4	32. 0 0	144	1, 76 2. 56	4, 60 8. 00	-
3010 57	汇隆 新材	2021 -08- 31	2022 -03- 09	创业 板打 新限 售	8. 03	19. 0 2	218	1, 75 0. 54	4, 14 6. 36	-
3010 68	大地 海洋	2021 -09- 16	2022 -03- 28	创业 板打 新限 售	13. 9 8	28. 3 8	144	2, 01 3. 12	4, 08 6. 72	-
3010 79	邵阳 液压	2021 -10- 11	2022 -04- 19	创业 板打 新限 售	11. 9 2	24. 8 2	140	1, 66 8. 80	3, 47 4. 80	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日（含）后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、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。

4、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。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。”

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股	股	停	停	期	复	复	数量	期末成本	期末估值	备
---	---	---	---	---	---	---	----	------	------	---

票 代 码	票 名 称	牌 日 期	牌 原 因	末 估 值 单 价	牌 日 期	牌 开 盘 单 价	(股)	总额	总额	注
002 683	广 东 宏 大	202 1-1 2-2 0	重 大 事 项	30. 12	202 2-0 1-0 4	31. 00	87,000	2,638,06 7.96	2,620,44 0.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人的托管账户，开立于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主要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12月31日，本基金无债券投资（2020年12月31日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	44,726,419.22	—	—	—	44,726,419.22
交易性金融资产	—	—	—	674,161,400.26	674,161,400.26
应收利息	—	—	—	14,531.44	14,531.44
应收申购款	—	—	—	1,721,157.41	1,721,157.41
资产总计	44,726,419.22	—	—	675,897,089.11	720,623,508.33
负债					
应付赎回款	—	—	—	3,085,302.98	3,085,302.98
应付管理人报酬	—	—	—	463,254.59	463,254.59
应付托管费	—	—	—	61,767.28	61,767.28
应付销售服务费	—	—	—	101,236.18	101,236.18
其他负债	—	—	—	100,986.95	100,986.95
负债总计	—	—	—	3,812,547.98	3,812,547.98
利率敏感度缺	44,726,419.22	—	—	672,084,541.13	716,810,960.35

口					
上年度 末 2020年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,735,866.60	-	-	-	20,735,866.60
交易性金融资产	-	-	-	131,755,029.87	131,755,029.87
应收利息	-	-	-	2,691.40	2,691.40
应收申购款	-	-	-	322,538.42	322,538.42
资产总计	20,735,866.60	-	-	132,080,259.69	152,816,126.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,960,891.98	12,960,891.98
应付管理人报酬	-	-	-	94,531.75	94,531.75
应付托管费	-	-	-	12,604.24	12,604.24
应付销售服务费	-	-	-	16,442.22	16,442.22
其他负债	-	-	-	180,186.22	180,186.22
负债总计	-	-	-	13,264,656.41	13,264,656.41
利率敏感度缺口	20,735,866.60	-	-	118,815,603.28	139,551,469.88

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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（2021年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2021年12月31日	占基金资产净值比例(%)	2020年12月31日	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	674,161,400.26	94.05	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	—	—	—	—

一权证投资				
其他	—	—	—	—
合计	674, 161, 400. 26	94. 05	131, 755, 029. 87	94. 41

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		
	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）	
分析		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
业绩比较基准上升5%	35, 702, 045. 18	—	
	业绩比较基准下降5%	-35, 702, 045. 18	—

注：于2020年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为669, 919, 101. 89元，属于第二层次的余额为2, 625, 944. 49元，属于第三层次的余额为1, 616, 353. 88元（2020年12月31日：第一层次130, 539, 520. 08元，第二层次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

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具1,616,353.88元(2020年12月31日：未持有公允价值归属于第三层次的金融工具)。其中，于本会计期间购买第三层次金融工具的金额为0元，转入第三层次金融工具的金额为725,709.51元，计入损益的利得或损失金额为890,644.37元，均为2021年12月31日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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)根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	674, 161, 400. 26	93. 55
	其中：股票	674, 161, 400. 26	93. 55
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	44, 726, 419. 22	6. 21
8	其他各项资产	1, 735, 688. 85	0. 24
9	合计	720, 623, 508. 33	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	581, 334. 00	0. 08
B	采矿业	33, 488, 479. 68	4. 67
C	制造业	342, 755, 952. 08	47. 82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21, 743, 118. 00	3. 03
E	建筑业	10, 365, 107. 70	1. 45
F	批发和零售业	17, 990, 949. 00	2. 51
G	交通运输、仓储和邮政业	23, 533, 962. 59	3. 28
H	住宿和餐饮业	1, 582, 200. 00	0. 22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49, 890, 431. 50	6. 96
J	金融业	31, 543, 916. 12	4. 40

K	房地产业	21, 174, 758. 54	2. 95
L	租赁和商务服务业	13, 564, 143. 42	1. 89
M	科学、研究和技术服务业	1, 846, 880. 00	0. 26
N	水利、环境和公共设施管理业	5, 192, 566. 00	0. 72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4, 343, 958. 00	0. 61
R	文化、体育和娱乐业	13, 313, 480. 04	1. 86
S	综合	3, 906, 312. 00	0. 54
	合计	596, 817, 548. 67	83. 26

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	-	-
B	采矿业	4, 040, 815. 00	0. 56
C	制造业	53, 040, 277. 46	7. 40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	803, 996. 00	0. 11
E	建筑业	3, 728, 423. 96	0. 52
F	批发和零售业	2, 595, 525. 54	0. 36
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 595, 824. 00	0. 22
H	住宿和餐饮业	4, 608. 00	0. 00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	797, 193. 65	0. 11
J	金融业	2, 404, 089. 00	0. 34
K	房地产业	1, 600, 222. 00	0. 22
L	租赁和商务服务业	2, 430, 518. 00	0. 34
M	科学、研究和技术服务业	1, 655, 766. 44	0. 23
N	水利、环境和公共设施管理业	968, 244. 85	0. 14

	理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	831,162.78	0.12
R	文化、体育和娱乐业	30,668.91	0.00
S	综合	816,516.00	0.11
	合计	77,343,851.59	10.79

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601156	东航物流	276,600	6,052,008.00	0.84
2	002867	周大生	326,500	5,805,170.00	0.81
3	002557	洽洽食品	94,486	5,797,660.96	0.81
4	000623	吉林敖东	313,700	5,794,039.00	0.81
5	000988	华工科技	202,700	5,647,222.00	0.79
6	000887	中鼎股份	258,000	5,626,980.00	0.79
7	600141	兴发集团	136,198	5,159,180.24	0.72
8	002191	劲嘉股份	337,300	5,103,349.00	0.71
9	002156	通富微电	258,500	5,022,655.00	0.70
10	601128	常熟银行	757,700	5,008,397.00	0.70
11	003022	联泓新科	137,200	4,999,568.00	0.70
12	002745	木林森	329,000	4,977,770.00	0.69
13	300618	寒锐钴业	61,900	4,963,142.00	0.69
14	002128	电投能源	334,100	4,961,385.00	0.69

15	000960	锡业股份	254,000	4,960,620.00	0.69
16	000959	首钢股份	861,800	4,938,114.00	0.69
17	300741	华宝股份	102,800	4,918,980.00	0.69
18	300699	光威复材	58,000	4,899,840.00	0.68
19	601689	拓普集团	91,800	4,865,400.00	0.68
20	000970	中科三环	301,900	4,845,495.00	0.68
21	688536	思瑞浦	6,300	4,838,400.00	0.67
22	600348	阳泉煤业	398,300	4,719,855.00	0.66
23	300363	博腾股份	52,600	4,705,070.00	0.66
24	002416	爱施德	404,400	4,602,072.00	0.64
25	601699	潞安环能	406,400	4,596,384.00	0.64
26	600325	华发股份	755,200	4,546,304.00	0.63
27	300630	普利制药	82,463	4,538,763.52	0.63
28	600885	宏发股份	60,200	4,493,328.00	0.63
29	000598	兴蓉环境	710,900	4,492,888.00	0.63
30	002223	鱼跃医疗	118,800	4,490,640.00	0.63
31	603613	国联股份	41,600	4,472,000.00	0.62
32	300418	昆仑万维	193,000	4,467,950.00	0.62
33	300244	迪安诊断	129,400	4,343,958.00	0.61
34	601598	中国外运	968,200	4,337,536.00	0.61
35	002939	长城证券	331,600	4,294,220.00	0.60
36	002010	传化智联	491,900	4,279,530.00	0.60
37	002180	纳思达	88,600	4,231,536.00	0.59
38	600970	中材国际	370,000	4,229,100.00	0.59
39	300072	三聚环保	516,300	4,094,259.00	0.57
40	000883	湖北能源	756,300	3,963,012.00	0.55
41	600673	东阳光	439,900	3,906,312.00	0.54
42	000039	中集集团	226,700	3,890,172.00	0.54
43	603868	飞科电器	89,500	3,886,090.00	0.54
44	601615	明阳智能	147,700	3,854,970.00	0.54
45	000709	河钢股份	1,554,000	3,822,840.00	0.53

46	002174	游族网络	250,500	3,817,620.00	0.53
47	002739	万达电影	245,400	3,798,792.00	0.53
48	002505	鹏都农牧	980,300	3,744,746.00	0.52
49	603225	新凤鸣	252,100	3,743,685.00	0.52
50	002244	滨江集团	796,600	3,712,156.00	0.52
51	002434	万里扬	251,600	3,708,584.00	0.52
52	002387	维信诺	395,900	3,673,952.00	0.51
53	600884	杉杉股份	112,000	3,670,240.00	0.51
54	000830	鲁西化工	240,400	3,668,504.00	0.51
55	603379	三美股份	160,800	3,663,024.00	0.51
56	000877	天山股份	238,800	3,656,028.00	0.51
57	601000	唐山港	1,308,810	3,599,227.50	0.50
58	002831	裕同科技	106,800	3,598,092.00	0.50
59	300724	捷佳伟创	31,180	3,563,874.00	0.50
60	300253	卫宁健康	210,900	3,534,684.00	0.49
61	000559	万向钱潮	552,500	3,519,425.00	0.49
62	000990	诚志股份	222,400	3,518,368.00	0.49
63	600188	兖州煤业	148,600	3,496,558.00	0.49
64	002368	太极股份	126,100	3,472,794.00	0.48
65	603456	九洲药业	61,500	3,459,990.00	0.48
66	002203	海亮股份	276,600	3,438,138.00	0.48
67	601778	晶科科技	401,300	3,423,089.00	0.48
68	600500	中化国际	398,700	3,412,872.00	0.48
69	000729	燕京啤酒	399,100	3,380,377.00	0.47
70	002048	宁波华翔	151,800	3,283,434.00	0.46
71	000060	中金岭南	666,342	3,271,739.22	0.46
72	002430	杭氧股份	108,300	3,250,083.00	0.45
73	000062	深圳华强	188,300	3,244,409.00	0.45
74	600522	中天科技	189,200	3,208,832.00	0.45
75	601333	广深铁路	1,425,200	3,192,448.00	0.45
76	002013	中航机电	174,400	3,170,592.00	0.44

77	600329	中新药业	100,700	3,162,987.00	0.44
78	002946	新乳业	197,400	3,146,556.00	0.44
79	000400	许继电气	118,500	3,092,850.00	0.43
80	002268	卫士通	55,200	3,087,888.00	0.43
81	600131	国网信通	136,700	2,986,895.00	0.42
82	002273	水晶光电	171,400	2,980,646.00	0.42
83	002183	怡亚通	446,200	2,953,844.00	0.41
84	000415	渤海租赁	1,014,600	2,952,486.00	0.41
85	603589	口子窖	41,500	2,941,105.00	0.41
86	600803	新奥股份	158,100	2,902,716.00	0.40
87	001914	招商积余	137,900	2,793,854.00	0.39
88	000156	华数传媒	329,374	2,786,504.04	0.39
89	000739	普洛药业	79,300	2,782,637.00	0.39
90	000686	东北证券	316,400	2,777,992.00	0.39
91	300474	景嘉微	18,100	2,754,820.00	0.38
92	605358	立昂微	22,800	2,736,228.00	0.38
93	300168	万达信息	207,300	2,699,046.00	0.38
94	000717	韶钢松山	565,000	2,683,750.00	0.37
95	601958	金钼股份	391,500	2,681,775.00	0.37
96	002294	信立泰	97,100	2,652,772.00	0.37
97	600909	华安证券	488,600	2,643,326.00	0.37
98	600623	华谊集团	290,200	2,640,820.00	0.37
99	600967	内蒙一机	220,400	2,633,780.00	0.37
100	002683	广东宏大	87,000	2,620,440.00	0.37
101	600120	浙江东方	592,000	2,616,640.00	0.37
102	600959	江苏有线	782,930	2,575,839.70	0.36
103	002065	东华软件	326,200	2,544,360.00	0.35
104	002396	星网锐捷	107,800	2,540,846.00	0.35
105	603156	养元饮品	89,200	2,534,172.00	0.35
106	002056	横店东磁	133,600	2,521,032.00	0.35
107	601098	中南传媒	262,700	2,514,039.00	0.35

108	002422	科伦药业	132,600	2,510,118.00	0.35
109	002185	华天科技	196,900	2,502,599.00	0.35
110	688321	微芯生物	71,200	2,492,712.00	0.35
111	600256	广汇能源	370,900	2,425,686.00	0.34
112	600765	中航重机	48,000	2,423,520.00	0.34
113	002212	天融信	125,900	2,413,503.00	0.34
114	600642	申能股份	323,700	2,385,669.00	0.33
115	600039	四川路桥	197,836	2,381,945.44	0.33
116	601928	凤凰传媒	292,500	2,366,325.00	0.33
117	603707	健友股份	55,800	2,343,600.00	0.33
118	000898	鞍钢股份	624,900	2,343,375.00	0.33
119	002439	启明星辰	82,000	2,339,460.00	0.33
120	603883	老百姓	46,900	2,315,922.00	0.32
121	603712	七一二	52,500	2,273,250.00	0.32
122	002508	老板电器	62,400	2,247,648.00	0.31
123	002384	东山精密	82,400	2,233,040.00	0.31
124	002399	海普瑞	128,700	2,200,770.00	0.31
125	601992	金隅集团	747,000	2,121,480.00	0.30
126	601717	郑煤机	180,200	2,088,518.00	0.29
127	600339	中油工程	671,700	2,068,836.00	0.29
128	002266	浙富控股	289,600	2,061,952.00	0.29
129	002138	顺络电子	54,000	2,061,720.00	0.29
130	002948	青岛银行	442,100	2,046,923.00	0.29
131	000537	广宇发展	84,700	2,041,270.00	0.28
132	688088	虹软科技	45,470	2,003,408.20	0.28
133	000738	航发控制	64,300	1,947,004.00	0.27
134	603228	景旺电子	55,900	1,930,227.00	0.27
135	001203	大中矿业	126,700	1,910,636.00	0.27
136	600373	中文传媒	149,500	1,847,820.00	0.26
137	603127	昭衍新药	16,000	1,846,880.00	0.26
138	000728	国元证券	236,700	1,822,590.00	0.25

139	600546	山煤国际	221,400	1,817,694.00	0.25
140	000636	风华高科	60,800	1,811,840.00	0.25
141	601611	中国核建	180,894	1,803,513.18	0.25
142	600415	小商品城	369,517	1,792,157.45	0.25
143	000581	威孚高科	82,900	1,785,666.00	0.25
144	600968	海油发展	608,700	1,783,491.00	0.25
145	000778	新兴铸管	408,200	1,767,506.00	0.25
146	002444	巨星科技	57,100	1,742,121.00	0.24
147	600637	东方明珠	183,200	1,731,240.00	0.24
148	300146	汤臣倍健	64,100	1,728,136.00	0.24
149	600027	华电国际	321,000	1,717,350.00	0.24
150	002701	奥瑞金	244,900	1,714,300.00	0.24
151	000027	深圳能源	208,900	1,692,090.00	0.24
152	000553	安道麦A	200,000	1,688,000.00	0.24
153	002372	伟星新材	67,300	1,636,736.00	0.23
154	600739	辽宁成大	82,900	1,618,208.00	0.23
155	601179	中国西电	291,300	1,616,715.00	0.23
156	600160	巨化股份	124,900	1,612,459.00	0.22
157	002507	涪陵榨菜	42,600	1,610,280.00	0.22
158	000513	丽珠集团	40,000	1,608,400.00	0.22
159	300088	长信科技	120,900	1,605,552.00	0.22
160	600787	中储股份	256,700	1,601,808.00	0.22
161	600282	南钢股份	432,700	1,600,990.00	0.22
162	002409	雅克科技	19,700	1,599,049.00	0.22
163	300115	长盈精密	80,400	1,595,136.00	0.22
164	603866	桃李面包	56,100	1,593,240.00	0.22
165	601117	中国化学	132,700	1,592,400.00	0.22
166	600299	安迪苏	129,200	1,591,744.00	0.22
167	600177	雅戈尔	230,900	1,590,901.00	0.22
168	601872	招商轮船	388,000	1,590,800.00	0.22
169	002705	新宝股份	64,400	1,590,680.00	0.22

170	600663	陆家嘴	146,389	1,589,784.54	0.22
171	002926	华西证券	161,300	1,588,805.00	0.22
172	600862	中航高科	44,400	1,587,744.00	0.22
173	601828	美凯龙	180,037	1,586,125.97	0.22
174	601555	东吴证券	178,790	1,584,079.40	0.22
175	600233	圆通速递	94,900	1,582,932.00	0.22
176	601568	北元集团	194,700	1,582,911.00	0.22
177	600928	西安银行	368,076	1,582,726.80	0.22
178	600754	锦江酒店	27,000	1,582,200.00	0.22
179	002673	西部证券	195,900	1,580,913.00	0.22
180	300285	国瓷材料	37,100	1,579,347.00	0.22
181	001965	招商公路	205,400	1,575,418.00	0.22
182	600705	中航资本	396,800	1,575,296.00	0.22
183	000519	中兵红箭	59,000	1,573,530.00	0.22
184	600529	山东药玻	35,800	1,571,620.00	0.22
185	603568	伟明环保	43,000	1,570,790.00	0.22
186	300308	中际旭创	36,900	1,568,250.00	0.22
187	600398	海澜之家	244,500	1,567,245.00	0.22
188	002506	协鑫集成	412,300	1,566,740.00	0.22
189	600399	抚顺特钢	63,200	1,565,464.00	0.22
190	603650	彤程新材	31,100	1,564,952.00	0.22
191	002028	思源电气	31,800	1,564,878.00	0.22
192	601456	国联证券	111,900	1,563,243.00	0.22
193	300212	易华录	44,200	1,562,470.00	0.22
194	600482	中国动力	79,300	1,562,210.00	0.22
195	000967	盈峰环境	212,800	1,559,824.00	0.22
196	002080	中材科技	45,600	1,551,312.00	0.22
197	600038	中直股份	19,300	1,549,790.00	0.22
198	600418	江淮汽车	88,900	1,546,860.00	0.22
199	600875	东方电气	71,700	1,535,814.00	0.21
200	688065	凯赛生物	8,300	1,529,524.00	0.21

201	000937	冀中能源	258,300	1,423,233.00	0.20
202	600657	信达地产	367,100	1,369,283.00	0.19
203	600823	世茂股份	321,600	1,054,848.00	0.15
204	600064	南京高科	109,900	1,026,466.00	0.14
205	600639	浦东金桥	80,100	1,022,877.00	0.14
206	300271	华宇软件	75,900	963,930.00	0.13
207	603198	迎驾贡酒	11,800	819,510.00	0.11
208	000685	中山公用	91,400	808,890.00	0.11
209	300009	安科生物	61,500	805,035.00	0.11
210	300296	利亚德	78,200	801,550.00	0.11
211	000983	山西焦煤	96,700	799,709.00	0.11
212	000733	振华科技	6,300	782,964.00	0.11
213	002440	闰土股份	76,400	732,676.00	0.10
214	002815	崇达技术	42,400	714,440.00	0.10
215	600060	海信视像	53,100	714,195.00	0.10
216	000961	中南建设	168,100	695,934.00	0.10
217	000031	大悦城	185,800	693,034.00	0.10
218	600729	重庆百货	24,900	647,898.00	0.09
219	002458	益生股份	51,400	581,334.00	0.08
220	600649	城投控股	110,200	452,922.00	0.06
221	600582	天地科技	93,300	408,654.00	0.06
222	002004	华邦健康	53,700	388,788.00	0.05
223	002670	国盛金控	38,300	367,680.00	0.05
224	600917	重庆燃气	42,600	357,414.00	0.05
225	002375	亚厦股份	47,700	357,273.00	0.05
226	600126	杭钢股份	62,400	320,112.00	0.04
227	300257	开山股份	19,800	314,424.00	0.04
228	002075	沙钢股份	53,200	310,156.00	0.04
229	000046	泛海控股	146,300	275,044.00	0.04
230	300166	东方国信	24,600	265,680.00	0.04
231	601187	厦门银行	31,200	215,280.00	0.03

232	600376	首开股份	31, 100	176, 026. 00	0. 02
233	601718	际华集团	56, 000	166, 880. 00	0. 02
234	600728	佳都科技	13, 400	111, 622. 00	0. 02
235	002038	双鹭药业	3, 000	32, 430. 00	0. 00
236	600835	上海机电	1, 700	27, 064. 00	0. 00
237	603515	欧普照明	1, 300	26, 988. 00	0. 00
238	600298	安琪酵母	79	4, 768. 44	0. 00
239	603638	艾迪精密	80	2, 553. 60	0. 00
240	300482	万孚生物	60	2, 362. 80	0. 00
241	300001	特锐德	84	2, 089. 08	0. 00
242	603927	中科软	60	1, 641. 60	0. 00
243	603885	吉祥航空	73	1, 295. 75	0. 00
244	000050	深天马 A	88	1, 145. 76	0. 00
245	002572	索菲亚	43	954. 60	0. 00
246	600667	太极实业	71	573. 68	0. 00
247	002092	中泰化学	57	543. 78	0. 00
248	000975	银泰黄金	56	491. 68	0. 00
249	601298	青岛港	86	489. 34	0. 00
250	600390	五矿资本	81	430. 92	0. 00
251	002390	信邦制药	58	430. 36	0. 00
252	002500	山西证券	50	330. 00	0. 00
253	600170	上海建工	84	302. 40	0. 00
254	600839	四川长虹	52	172. 12	0. 00
255	002563	森马服饰	20	154. 60	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	601868	中国能建	472, 189	1, 289, 075. 97	0. 18

2	002727	一心堂	22,100	851,071.00	0.12
3	600456	宝钛股份	11,700	839,826.00	0.12
4	603886	元祖股份	35,600	838,380.00	0.12
5	603008	喜临门	21,300	831,339.00	0.12
6	002597	金禾实业	16,100	826,735.00	0.12
7	002545	东方铁塔	89,900	819,888.00	0.11
8	603986	兆易创新	4,660	819,461.00	0.11
9	300118	东方日升	25,200	818,244.00	0.11
10	002687	乔治白	115,500	816,585.00	0.11
11	000833	粤桂股份	122,600	816,516.00	0.11
12	002738	中矿资源	11,600	816,176.00	0.11
13	002539	云图控股	61,500	816,105.00	0.11
14	601088	中国神华	36,200	815,224.00	0.11
15	601882	海天精工	32,900	814,933.00	0.11
16	300268	佳沃食品	43,900	813,906.00	0.11
17	603836	海程邦达	31,000	813,750.00	0.11
18	603882	金域医学	7,300	813,001.00	0.11
19	300503	昊志机电	63,200	812,752.00	0.11
20	002790	瑞尔特	85,900	812,614.00	0.11
21	000568	泸州老窖	3,200	812,384.00	0.11
22	002978	安宁股份	19,200	811,776.00	0.11
23	300416	苏试试验	23,900	811,405.00	0.11
24	603833	欧派家居	5,500	811,250.00	0.11
25	600248	延长化建	168,900	810,720.00	0.11
26	601668	中国建筑	162,000	810,000.00	0.11
27	002765	蓝黛科技	96,400	809,760.00	0.11
28	000977	浪潮信息	22,600	809,758.00	0.11
29	600873	梅花生物	105,500	809,185.00	0.11
30	600295	鄂尔多斯	34,300	809,137.00	0.11
31	601225	陕西煤业	66,300	808,860.00	0.11
32	000657	中钨高新	50,300	808,824.00	0.11

33	300781	因赛集团	34,000	808,520.00	0.11
34	600057	厦门象屿	95,200	808,248.00	0.11
35	300073	当升科技	9,300	807,891.00	0.11
36	000929	兰州黄河	82,300	807,363.00	0.11
37	000063	中兴通讯	24,100	807,350.00	0.11
38	000498	山东路桥	130,600	807,108.00	0.11
39	600176	中国巨石	44,300	806,260.00	0.11
40	002601	龙佰集团	28,200	806,238.00	0.11
41	300852	四会富仕	13,800	806,196.00	0.11
42	002573	清新环境	110,700	805,896.00	0.11
43	002449	国星光电	74,700	805,266.00	0.11
44	600438	通威股份	17,900	804,784.00	0.11
45	600089	特变电工	38,000	804,460.00	0.11
46	600887	伊利股份	19,400	804,324.00	0.11
47	000938	紫光股份	35,200	804,320.00	0.11
48	603610	麒盛科技	31,100	804,246.00	0.11
49	000732	泰禾集团	363,800	803,998.00	0.11
50	605169	洪通燃气	47,800	803,996.00	0.11
51	600123	兰花科创	85,800	803,946.00	0.11
52	002064	华峰化学	77,000	803,880.00	0.11
53	600335	国机汽车	92,600	803,768.00	0.11
54	300012	华测检测	29,900	803,413.00	0.11
55	600018	上港集团	146,600	803,368.00	0.11
56	300358	楚天科技	30,800	802,956.00	0.11
57	002806	华锋股份	53,700	802,815.00	0.11
58	300327	中颖电子	11,820	802,578.00	0.11
59	601881	中国银河	71,700	802,323.00	0.11
60	300623	捷捷微电	25,500	802,230.00	0.11
61	002254	泰和新材	40,900	802,049.00	0.11
62	300059	东方财富	21,600	801,576.00	0.11
63	002585	双星新材	29,600	801,568.00	0.11

64	300755	华致酒行	16,000	801,280.00	0.11
65	601666	平煤股份	95,700	801,009.00	0.11
66	002206	海利得	90,200	800,976.00	0.11
67	601233	桐昆股份	37,800	800,604.00	0.11
68	601658	邮储银行	156,900	800,190.00	0.11
69	603369	今世缘	14,700	799,680.00	0.11
70	603517	绝味食品	11,700	799,461.00	0.11
71	600499	科达制造	32,200	799,204.00	0.11
72	002008	大族激光	14,800	799,200.00	0.11
73	600183	生益科技	33,900	798,345.00	0.11
74	002760	凤形股份	30,500	796,660.00	0.11
75	000069	华侨城 A	113,100	796,224.00	0.11
76	000725	京东方 A	157,600	795,880.00	0.11
77	603599	广信股份	20,400	795,600.00	0.11
78	601339	百隆东方	135,000	795,150.00	0.11
79	603816	顾家家居	10,300	794,748.00	0.11
80	300911	亿田智能	9,700	794,624.00	0.11
81	002517	恺英网络	136,400	793,848.00	0.11
82	002003	伟星股份	61,900	793,558.00	0.11
83	002129	中环股份	19,000	793,250.00	0.11
84	601919	中远海控	42,400	792,456.00	0.11
85	600779	水井坊	6,600	791,934.00	0.11
86	300587	天铁股份	39,600	790,812.00	0.11
87	300035	中科电气	26,100	789,525.00	0.11
88	300514	友讯达	62,300	788,718.00	0.11
89	300171	东富龙	15,600	788,424.00	0.11
90	002648	卫星化学	19,600	784,588.00	0.11
91	002932	明德生物	10,500	777,000.00	0.11
92	300750	宁德时代	1,300	764,400.00	0.11
93	603115	海星股份	29,100	762,420.00	0.11
94	688385	复旦微电	8,852	430,030.16	0.06

95	688303	大全能源	5, 156	311, 989. 56	0. 04
96	300774	倍杰特	4, 435	97, 161. 52	0. 01
97	688210	统联精密	2, 218	87, 677. 54	0. 01
98	688696	极米科技	135	74, 520. 00	0. 01
99	301083	百胜智能	4, 160	70, 270. 72	0. 01
100	301155	海力风电	662	64, 048. 50	0. 01
101	300854	中兰环保	2, 026	58, 735. 01	0. 01
102	301177	迪阿股份	423	49, 101. 84	0. 01
103	301050	雷电微力	180	42, 253. 20	0. 01
104	301029	怡合达	462	41, 519. 94	0. 01
105	603230	内蒙新华	1, 140	29, 491. 80	0. 00
106	301087	可孚医疗	379	28, 553. 86	0. 00
107	301090	华润材料	2, 389	26, 804. 58	0. 00
108	301099	雅创电子	351	25, 047. 36	0. 00
109	301189	奥尼电子	435	24, 629. 70	0. 00
110	301166	优宁维	253	23, 908. 50	0. 00
111	301069	凯盛新材	539	23, 829. 19	0. 00
112	301096	百诚医药	272	21, 360. 16	0. 00
113	301082	久盛电气	915	19, 699. 95	0. 00
114	301093	华兰股份	385	19, 192. 25	0. 00
115	300994	久祺股份	420	19, 089. 00	0. 00
116	301100	风光股份	599	18, 652. 86	0. 00
117	001296	长江材料	310	18, 376. 80	0. 00
118	301060	兰卫医学	587	18, 161. 78	0. 00
119	301088	戎美股份	692	17, 071. 64	0. 00
120	301118	恒光股份	315	15, 441. 30	0. 00
121	301089	拓新药业	220	14, 944. 60	0. 00
122	301046	能辉科技	290	14, 207. 10	0. 00
123	301111	粤万年青	379	13, 901. 72	0. 00
124	301017	漱玉平民	555	13, 209. 00	0. 00
125	301199	迈赫股份	402	12, 864. 00	0. 00

126	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
127	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
128	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
129	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
130	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
131	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
132	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
133	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
134	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
135	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
136	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
137	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
138	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
139	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
140	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
141	603799	华友钴业	58	6,397.98	0.00
142	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
143	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
144	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
145	301036	双乐股份	200	5,986.00	0.00
146	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
147	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
148	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
149	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
150	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
151	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
152	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
153	301011	华立科技	75	4,515.00	0.00
154	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
155	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
156	301012	扬电科技	70	3,544.80	0.00

157	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
158	600845	宝信软件	55	3,345.65	0.00
159	603217	元利科技	60	3,040.80	0.00
160	002415	海康威视	58	3,034.56	0.00
161	300985	致远新能	59	2,892.18	0.00
162	300995	奇德新材	91	2,521.61	0.00
163	603213	镇洋发展	99	2,292.84	0.00
164	301015	百洋医药	62	1,878.60	0.00
165	603048	浙江黎明	64	1,856.00	0.00
166	301013	利和兴	71	1,824.70	0.00
167	603216	梦天家居	72	1,820.88	0.00
168	001207	联科科技	82	1,794.16	0.00
169	603033	三维股份	68	1,758.48	0.00
170	300709	精研科技	24	1,438.80	0.00
171	605577	龙版传媒	77	1,129.59	0.00
172	300382	斯莱克	38	875.52	0.00
173	001288	运机集团	37	658.97	0.00
174	603219	富佳股份	28	554.12	0.00
175	300993	玉马遮阳	10	287.10	0.00
176	600219	南山铝业	60	282.60	0.00
177	600312	平高电气	27	245.43	0.00
178	600935	华塑股份	11	84.04	0.00
179	605507	国邦医药	2	57.66	0.00
180	300027	华谊兄弟	12	47.52	0.00
181	600682	南京新百	1	11.76	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	002867	周大生	19, 474, 738. 51	13. 96
2	600546	山煤国际	19, 037, 597. 00	13. 64
3	601128	常熟银行	18, 907, 611. 00	13. 55
4	603256	宏和科技	17, 059, 065. 00	12. 22
5	600141	兴发集团	16, 441, 710. 06	11. 78
6	002458	益生股份	16, 312, 421. 50	11. 69
7	600282	南钢股份	16, 052, 873. 00	11. 50
8	688208	道通科技	15, 889, 342. 84	11. 39
9	002416	爱施德	15, 720, 908. 00	11. 27
10	300168	万达信息	15, 492, 212. 00	11. 10
11	002244	滨江集团	15, 399, 886. 83	11. 04
12	600808	马钢股份	15, 399, 249. 76	11. 03
13	600348	阳泉煤业	15, 309, 040. 20	10. 97
14	002396	星网锐捷	14, 931, 596. 76	10. 70
15	000898	鞍钢股份	14, 855, 351. 37	10. 65
16	000729	燕京啤酒	14, 762, 255. 00	10. 58
17	002092	中泰化学	14, 698, 770. 43	10. 53
18	601598	中国外运	14, 574, 669. 72	10. 44
19	002004	华邦健康	14, 565, 967. 92	10. 44
20	002648	卫星化学	14, 512, 459. 75	10. 40
21	600884	杉杉股份	14, 486, 327. 00	10. 38
22	000732	泰禾集团	14, 391, 680. 80	10. 31
23	000519	中兵红箭	14, 366, 625. 41	10. 29
24	601699	潞安环能	14, 340, 444. 80	10. 28
25	000830	鲁西化工	14, 308, 952. 00	10. 25
26	002368	太极股份	14, 288, 798. 85	10. 24
27	000970	中科三环	14, 255, 288. 00	10. 22
28	002557	洽洽食品	14, 226, 871. 77	10. 19
29	600582	天地科技	14, 201, 786. 00	10. 18
30	002128	电投能源	14, 060, 571. 00	10. 08
31	300316	晶盛机电	14, 058, 575. 54	10. 07

32	603379	三美股份	14, 030, 647. 12	10. 05
33	600782	新钢股份	13, 987, 519. 25	10. 02
34	601098	中南传媒	13, 987, 464. 54	10. 02
35	600089	特变电工	13, 950, 739. 05	10. 00
36	000983	山西焦煤	13, 883, 399. 98	9. 95
37	000887	中鼎股份	13, 745, 104. 26	9. 85
38	600970	中材国际	13, 705, 702. 24	9. 82
39	603613	国联股份	13, 544, 074. 10	9. 71
40	600787	中储股份	13, 500, 983. 00	9. 67
41	600755	厦门国贸	13, 500, 767. 32	9. 67
42	000825	太钢不锈	13, 500, 075. 86	9. 67
43	000959	首钢股份	13, 348, 546. 00	9. 57
44	000636	风华高科	13, 326, 971. 57	9. 55
45	600985	淮北矿业	13, 287, 832. 00	9. 52
46	002048	宁波华翔	13, 260, 137. 38	9. 50
47	003022	联泓新科	13, 210, 438. 00	9. 47
48	000807	云铝股份	13, 201, 732. 53	9. 46
49	601689	拓普集团	13, 201, 216. 10	9. 46
50	002745	木林森	13, 050, 377. 00	9. 35
51	002434	万里扬	12, 956, 967. 66	9. 28
52	300618	寒锐钴业	12, 808, 488. 18	9. 18
53	603225	新凤鸣	12, 789, 566. 48	9. 16
54	000717	韶钢松山	12, 701, 449. 00	9. 10
55	603198	迎驾贡酒	12, 679, 849. 00	9. 09
56	002701	奥瑞金	12, 664, 678. 00	9. 08
57	000988	华工科技	12, 555, 778. 00	9. 00
58	002110	三钢闽光	12, 487, 939. 00	8. 95
59	600765	中航重机	12, 360, 508. 36	8. 86
60	600256	广汇能源	12, 282, 424. 00	8. 80
61	002013	中航机电	12, 207, 005. 00	8. 75
62	603156	养元饮品	12, 116, 550. 72	8. 68

63	600008	首创股份	12, 102, 558. 62	8. 67
64	600153	建发股份	12, 082, 061. 20	8. 66
65	600373	中文传媒	12, 018, 990. 00	8. 61
66	600188	兖州煤业	12, 001, 547. 00	8. 60
67	601615	明阳智能	11, 972, 612. 88	8. 58
68	600500	中化国际	11, 826, 485. 60	8. 47
69	002174	游族网络	11, 808, 639. 00	8. 46
70	601233	桐昆股份	11, 772, 769. 96	8. 44
71	001914	招商积余	11, 672, 711. 57	8. 36
72	002839	张家港行	11, 672, 123. 00	8. 36
73	002946	新乳业	11, 606, 134. 97	8. 32
74	002408	齐翔腾达	11, 510, 720. 80	8. 25
75	000960	锡业股份	11, 500, 431. 00	8. 24
76	002156	通富微电	11, 488, 525. 00	8. 23
77	000156	华数传媒	11, 467, 056. 78	8. 22
78	002138	顺络电子	11, 455, 607. 60	8. 21
79	000415	渤海租赁	11, 439, 749. 04	8. 20
80	000690	宝新能源	11, 425, 257. 00	8. 19
81	601969	海南矿业	11, 375, 185. 82	8. 15
82	300296	利亚德	11, 369, 191. 00	8. 15
83	600398	海澜之家	11, 354, 128. 00	8. 14
84	601333	广深铁路	11, 352, 333. 00	8. 13
85	002191	劲嘉股份	11, 348, 380. 00	8. 13
86	601636	旗滨集团	11, 239, 407. 83	8. 05
87	603883	老百姓	11, 216, 329. 94	8. 04
88	600516	方大炭素	11, 212, 098. 75	8. 03
89	000598	兴蓉环境	11, 146, 907. 00	7. 99
90	002080	中材科技	11, 103, 502. 82	7. 96
91	002223	鱼跃医疗	11, 048, 037. 00	7. 92
92	600039	四川路桥	10, 951, 647. 00	7. 85
93	002183	怡 亚 通	10, 908, 812. 00	7. 82

94	600885	宏发股份	10,877,338.59	7.79
95	002185	华天科技	10,853,507.00	7.78
96	603589	口子窖	10,830,662.56	7.76
97	000932	华菱钢铁	10,817,630.00	7.75
98	601928	凤凰传媒	10,800,356.00	7.74
99	000039	中集集团	10,747,904.00	7.70
100	000009	中国宝安	10,738,949.15	7.70
101	300699	光威复材	10,672,997.06	7.65
102	002268	卫士通	10,662,171.99	7.64
103	600325	华发股份	10,634,320.00	7.62
104	601778	晶科科技	10,607,589.00	7.60
105	600060	海信视像	10,588,807.10	7.59
106	300146	汤臣倍健	10,420,983.00	7.47
107	603885	吉祥航空	10,393,376.23	7.45
108	002572	索菲亚	10,376,082.90	7.44
109	002010	传化智联	10,325,068.00	7.40
110	601717	郑煤机	10,237,453.12	7.34
111	002563	森马服饰	10,196,886.32	7.31
112	600839	四川长虹	10,146,891.00	7.27
113	000937	冀中能源	10,052,911.00	7.20
114	300630	普利制药	10,029,153.76	7.19
115	300244	迪安诊断	10,025,716.40	7.18
116	300474	景嘉微	9,959,530.00	7.14
117	600663	陆家嘴	9,895,451.23	7.09
118	600637	东方明珠	9,881,866.42	7.08
119	002505	鹏都农牧	9,828,941.00	7.04
120	600315	上海家化	9,819,824.00	7.04
121	000999	华润三九	9,808,268.72	7.03
122	002390	信邦制药	9,789,703.12	7.02
123	603355	莱克电气	9,786,349.60	7.01
124	601512	中新集团	9,751,164.00	6.99

125	601828	美凯龙	9, 665, 869. 30	6. 93
126	000778	新兴铸管	9, 610, 505. 00	6. 89
127	002387	维信诺	9, 583, 215. 22	6. 87
128	600418	江淮汽车	9, 575, 465. 00	6. 86
129	002831	裕同科技	9, 490, 976. 00	6. 80
130	002266	浙富控股	9, 431, 508. 00	6. 76
131	300072	三聚环保	9, 391, 928. 99	6. 73
132	600131	国网信通	9, 360, 697. 18	6. 71
133	600642	申能股份	9, 350, 800. 68	6. 70
134	002372	伟星新材	9, 343, 356. 00	6. 70
135	000883	湖北能源	9, 341, 206. 00	6. 69
136	600754	锦江酒店	9, 337, 896. 00	6. 69
137	002212	天融信	9, 332, 990. 80	6. 69
138	600038	中直股份	9, 327, 293. 00	6. 68
139	600350	山东高速	9, 218, 572. 20	6. 61
140	601117	中国化学	9, 174, 927. 00	6. 57
141	600623	华谊集团	9, 172, 136. 96	6. 57
142	300001	特锐德	9, 126, 807. 15	6. 54
143	000400	许继电气	9, 116, 432. 00	6. 53
144	000559	万向钱潮	9, 097, 002. 40	6. 52
145	603868	飞科电器	9, 078, 772. 45	6. 51
146	600219	南山铝业	9, 044, 610. 00	6. 48
147	300741	华宝股份	9, 035, 850. 00	6. 47
148	002506	协鑫集成	9, 022, 838. 00	6. 47
149	000060	中金岭南	9, 010, 660. 54	6. 46
150	600673	东阳光	8, 995, 957. 00	6. 45
151	600959	江苏有线	8, 988, 518. 40	6. 44
152	000709	河钢股份	8, 982, 229. 00	6. 44
153	000739	普洛药业	8, 928, 866. 34	6. 40
154	600968	海油发展	8, 888, 938. 00	6. 37
155	600171	上海贝岭	8, 873, 461. 00	6. 36

156	603456	九洲药业	8,864,654.39	6.35
157	002705	新宝股份	8,783,927.68	6.29
158	000623	吉林敖东	8,756,713.26	6.27
159	601992	金隅集团	8,751,850.00	6.27
160	000990	诚志股份	8,695,221.38	6.23
161	000537	广宇发展	8,603,296.38	6.16
162	601139	深圳燃气	8,597,609.00	6.16
163	600329	中新药业	8,588,915.00	6.15
164	002273	水晶光电	8,562,014.00	6.14
165	600737	中粮糖业	8,561,851.00	6.14
166	000685	中山公用	8,559,485.00	6.13
167	002465	海格通信	8,551,633.00	6.13
168	002180	纳思达	8,474,429.67	6.07
169	002203	海亮股份	8,444,717.00	6.05
170	600027	华电国际	8,262,497.00	5.92
171	002444	巨星科技	8,207,904.00	5.88
172	601127	小康股份	8,154,670.00	5.84
173	603650	彤程新材	8,129,304.00	5.83
174	300363	博腾股份	8,098,103.00	5.80
175	002683	广东宏大	8,050,626.00	5.77
176	603638	艾迪精密	7,994,218.54	5.73
177	300182	捷成股份	7,990,038.00	5.73
178	600409	三友化工	7,963,864.01	5.71
179	002155	湖南黄金	7,954,999.70	5.70
180	601869	长飞光纤	7,946,692.60	5.69
181	002532	天山铝业	7,872,745.00	5.64
182	600160	巨化股份	7,860,108.00	5.63
183	300010	豆神教育	7,856,392.00	5.63
184	600739	辽宁成大	7,830,613.00	5.61
185	300418	昆仑万维	7,806,385.00	5.59
186	688536	思瑞浦	7,774,760.84	5.57

187	300253	卫宁健康	7, 773, 480. 00	5. 57
188	603377	东方时尚	7, 765, 123. 80	5. 56
189	605358	立昂微	7, 759, 648. 00	5. 56
190	000012	南玻 A	7, 680, 526. 49	5. 50
191	300383	光环新网	7, 646, 742. 00	5. 48
192	000581	威孚高科	7, 645, 161. 52	5. 48
193	600875	东方电气	7, 587, 994. 00	5. 44
194	600497	驰宏锌锗	7, 540, 959. 20	5. 40
195	688088	虹软科技	7, 483, 284. 12	5. 36
196	601456	国联证券	7, 353, 830. 00	5. 27
197	000961	中南建设	7, 343, 357. 00	5. 26
198	002065	东华软件	7, 319, 630. 00	5. 25
199	600466	蓝光发展	7, 289, 003. 00	5. 22
200	300482	万孚生物	7, 277, 887. 08	5. 22
201	600803	新奥股份	7, 267, 433. 00	5. 21
202	000998	隆平高科	7, 267, 155. 00	5. 21
203	688321	微芯生物	7, 222, 269. 80	5. 18
204	600390	五矿资本	7, 220, 524. 40	5. 17
205	600177	雅戈尔	7, 218, 600. 12	5. 17
206	002439	启明星辰	7, 161, 866. 00	5. 13
207	000062	深圳华强	7, 135, 902. 20	5. 11
208	000733	振华科技	7, 113, 988. 00	5. 10
209	000046	泛海控股	7, 113, 550. 00	5. 10
210	601156	东航物流	7, 086, 071. 30	5. 08
211	002056	横店东磁	7, 080, 857. 00	5. 07
212	002422	科伦药业	7, 040, 025. 00	5. 04
213	300212	易华录	6, 986, 794. 00	5. 01
214	601958	金钼股份	6, 939, 036. 00	4. 97
215	601068	中铝国际	6, 927, 167. 00	4. 96
216	601298	青岛港	6, 893, 621. 72	4. 94
217	002985	北摩高科	6, 874, 328. 70	4. 93

218	603786	科博达	6, 863, 650. 00	4. 92
219	300166	东方国信	6, 805, 260. 00	4. 88
220	603712	七一二	6, 775, 071. 00	4. 85
221	000686	东北证券	6, 755, 133. 60	4. 84
222	000050	深天马 A	6, 727, 828. 08	4. 82
223	002028	思源电气	6, 725, 397. 38	4. 82
224	600460	士兰微	6, 723, 448. 00	4. 82
225	603927	中科软	6, 652, 725. 60	4. 77
226	002690	美亚光电	6, 600, 627. 77	4. 73
227	600733	北汽蓝谷	6, 574, 184. 00	4. 71
228	603707	健友股份	6, 562, 114. 10	4. 70
229	300012	华测检测	6, 504, 540. 54	4. 66
230	600549	厦门钨业	6, 498, 300. 00	4. 66
231	600426	华鲁恒升	6, 454, 500. 00	4. 63
232	300009	安科生物	6, 450, 476. 60	4. 62
233	300308	中际旭创	6, 412, 760. 96	4. 60
234	000681	视觉中国	6, 396, 401. 00	4. 58
235	000501	鄂武商 A	6, 383, 817. 00	4. 57
236	002926	华西证券	6, 356, 433. 00	4. 55
237	000513	丽珠集团	6, 355, 305. 00	4. 55
238	600909	华安证券	6, 298, 853. 30	4. 51
239	002739	万达电影	6, 281, 758. 00	4. 50
240	002074	国轩高科	6, 181, 225. 00	4. 43
241	600026	中远海能	6, 161, 706. 00	4. 42
242	601668	中国建筑	6, 139, 199. 80	4. 40
243	002353	杰瑞股份	6, 132, 152. 26	4. 39
244	002507	涪陵榨菜	6, 123, 359. 31	4. 39
245	300002	神州泰岳	6, 085, 593. 40	4. 36
246	603816	顾家家居	6, 071, 997. 40	4. 35
247	000930	中粮科技	6, 050, 573. 00	4. 34
248	002709	天赐材料	6, 050, 354. 00	4. 34

249	002382	蓝帆医疗	6,034,975.24	4.32
250	600956	新天绿能	6,011,897.00	4.31
251	002317	众生药业	6,000,421.00	4.30
252	600649	城投控股	5,964,037.77	4.27
253	601881	中国银河	5,884,087.00	4.22
254	300207	欣旺达	5,883,967.00	4.22
255	002430	杭氧股份	5,883,708.00	4.22
256	603568	伟明环保	5,874,548.45	4.21
257	002294	信立泰	5,853,655.00	4.19
258	600908	无锡银行	5,834,397.00	4.18
259	000975	银泰黄金	5,803,758.28	4.16
260	600901	江苏租赁	5,801,971.00	4.16
261	600998	九州通	5,768,917.00	4.13
262	600258	首旅酒店	5,703,527.00	4.09
263	300251	光线传媒	5,692,767.00	4.08
264	603228	景旺电子	5,682,013.00	4.07
265	603866	桃李面包	5,671,827.24	4.06
266	600022	山东钢铁	5,627,009.00	4.03
267	300724	捷佳伟创	5,597,015.60	4.01
268	600376	首开股份	5,581,388.73	4.00
269	000738	航发控制	5,580,543.04	4.00
270	601187	厦门银行	5,578,588.40	4.00
271	600563	法拉电子	5,521,501.00	3.96
272	002818	富森美	5,502,483.90	3.94
273	600522	中天科技	5,487,840.00	3.93
274	601000	唐山港	5,481,474.70	3.93
275	000869	张 裕 A	5,459,194.60	3.91
276	002925	盈趣科技	5,455,355.44	3.91
277	603893	瑞芯微	5,417,481.00	3.88
278	600820	隧道股份	5,415,301.45	3.88
279	300750	宁德时代	5,415,084.80	3.88

280	601179	中国西电	5, 414, 470. 00	3. 88
281	601003	柳钢股份	5, 309, 943. 00	3. 81
282	002585	双星新材	5, 309, 856. 82	3. 80
283	600917	重庆燃气	5, 307, 803. 00	3. 80
284	603605	珀莱雅	5, 252, 533. 00	3. 76
285	002250	联化科技	5, 251, 684. 83	3. 76
286	600667	太极实业	5, 237, 392. 17	3. 75
287	600380	健康元	5, 228, 819. 00	3. 75
288	601866	中远海发	5, 187, 035. 72	3. 72
289	002625	光启技术	5, 165, 280. 00	3. 70
290	002299	圣农发展	5, 163, 990. 00	3. 70
291	600170	上海建工	5, 103, 998. 00	3. 66
292	300357	我武生物	5, 073, 390. 00	3. 64
293	300037	新宙邦	5, 069, 639. 00	3. 63
294	300059	东方财富	5, 031, 914. 00	3. 61
295	600307	酒钢宏兴	4, 994, 679. 13	3. 58
296	002375	亚厦股份	4, 986, 048. 00	3. 57
297	600823	世茂股份	4, 984, 775. 55	3. 57
298	002939	长城证券	4, 980, 472. 00	3. 57
299	000027	深圳能源	4, 964, 820. 10	3. 56
300	002078	太阳纸业	4, 932, 877. 00	3. 53
301	002064	华峰化学	4, 893, 711. 00	3. 51
302	603737	三棵树	4, 889, 651. 00	3. 50
303	601568	北元集团	4, 883, 164. 00	3. 50
304	600597	光明乳业	4, 883, 023. 00	3. 50
305	603515	欧普照明	4, 878, 235. 88	3. 50
306	601899	紫金矿业	4, 873, 530. 00	3. 49
307	600707	彩虹股份	4, 842, 272. 00	3. 47
308	001872	招商港口	4, 826, 910. 46	3. 46
309	603888	新华网	4, 825, 152. 04	3. 46
310	002738	中矿资源	4, 806, 541. 75	3. 44

311	002511	中顺洁柔	4, 782, 478. 56	3. 43
312	600928	西安银行	4, 779, 908. 65	3. 43
313	002075	沙钢股份	4, 707, 102. 00	3. 37
314	600312	平高电气	4, 688, 013. 14	3. 36
315	600645	中源协和	4, 686, 826. 00	3. 36
316	002601	龙佰集团	4, 590, 283. 00	3. 29
317	601555	东吴证券	4, 527, 544. 10	3. 24
318	300115	长盈精密	4, 525, 691. 00	3. 24
319	002765	蓝黛科技	4, 507, 201. 00	3. 23
320	600297	广汇汽车	4, 501, 973. 00	3. 23
321	300382	斯莱克	4, 477, 755. 65	3. 21
322	603882	金域医学	4, 469, 127. 00	3. 20
323	603317	天味食品	4, 410, 533. 62	3. 16
324	600862	中航高科	4, 399, 972. 00	3. 15
325	601966	玲珑轮胎	4, 356, 075. 06	3. 12
326	603127	昭衍新药	4, 344, 753. 00	3. 11
327	002948	青岛银行	4, 344, 480. 00	3. 11
328	601857	中国石油	4, 312, 109. 00	3. 09
329	002568	百润股份	4, 299, 748. 00	3. 08
330	002146	荣盛发展	4, 275, 212. 00	3. 06
331	002385	大北农	4, 262, 252. 00	3. 05
332	600486	扬农化工	4, 215, 503. 00	3. 02
333	300257	开山股份	4, 213, 282. 00	3. 02
334	000877	天山股份	4, 209, 786. 00	3. 02
335	600779	水井坊	4, 174, 742. 00	2. 99
336	300413	芒果超媒	4, 173, 320. 00	2. 99
337	600580	卧龙电驱	4, 153, 214. 00	2. 98
338	000977	浪潮信息	4, 143, 220. 80	2. 97
339	002423	中粮资本	4, 135, 078. 07	2. 96
340	002221	东华能源	4, 117, 169. 00	2. 95
341	601577	长沙银行	4, 115, 582. 00	2. 95

342	002756	永兴材料	4, 104, 374. 00	2. 94
343	603115	海星股份	4, 041, 107. 00	2. 90
344	600690	海尔智家	4, 036, 574. 00	2. 89
345	300088	长信科技	4, 027, 767. 33	2. 89
346	002500	山西证券	4, 024, 863. 00	2. 88
347	603260	合盛硅业	4, 023, 194. 00	2. 88
348	600511	国药股份	4, 016, 166. 00	2. 88
349	300294	博雅生物	4, 002, 711. 00	2. 87
350	000967	盈峰环境	3, 991, 143. 00	2. 86
351	603719	良品铺子	3, 988, 959. 00	2. 86
352	600123	兰花科创	3, 972, 371. 00	2. 85
353	600529	山东药玻	3, 957, 968. 19	2. 84
354	601168	西部矿业	3, 946, 515. 62	2. 83
355	300035	中科电气	3, 943, 542. 00	2. 83
356	600201	生物股份	3, 928, 009. 00	2. 81
357	601198	东兴证券	3, 908, 634. 00	2. 80
358	300223	北京君正	3, 907, 989. 00	2. 80
359	600126	杭钢股份	3, 892, 464. 00	2. 79
360	000568	泸州老窖	3, 889, 283. 00	2. 79
361	600216	浙江医药	3, 886, 959. 00	2. 79
362	601118	海南橡胶	3, 836, 008. 00	2. 75
363	600259	广晟有色	3, 799, 994. 00	2. 72
364	000553	安道麦A	3, 795, 699. 00	2. 72
365	601611	中国核建	3, 793, 712. 32	2. 72
366	600871	石化油服	3, 777, 469. 00	2. 71
367	300568	星源材质	3, 777, 315. 00	2. 71
368	000021	深科技	3, 753, 769. 00	2. 69
369	688002	睿创微纳	3, 750, 115. 99	2. 69
370	601155	新城控股	3, 738, 202. 00	2. 68
371	002241	歌尔股份	3, 707, 371. 00	2. 66
372	600699	均胜电子	3, 703, 205. 00	2. 65

373	603897	长城科技	3, 691, 198. 00	2. 65
374	600053	九鼎投资	3, 685, 778. 91	2. 64
375	600801	华新水泥	3, 679, 274. 46	2. 64
376	600643	爱建集团	3, 675, 638. 52	2. 63
377	603599	广信股份	3, 663, 228. 31	2. 63
378	002493	荣盛石化	3, 661, 072. 00	2. 62
379	600120	浙江东方	3, 655, 124. 04	2. 62
380	002966	苏州银行	3, 646, 345. 00	2. 61
381	002233	塔牌集团	3, 618, 491. 00	2. 59
382	600867	通化东宝	3, 611, 251. 20	2. 59
383	603517	绝味食品	3, 608, 636. 00	2. 59
384	600018	上港集团	3, 575, 582. 00	2. 56
385	300285	国瓷材料	3, 559, 594. 50	2. 55
386	001203	大中矿业	3, 559, 233. 82	2. 55
387	002508	老板电器	3, 534, 873. 56	2. 53
388	300463	迈克生物	3, 504, 565. 75	2. 51
389	000799	酒鬼酒	3, 490, 301. 48	2. 50
390	601880	大连港	3, 489, 870. 50	2. 50
391	600895	张江高科	3, 481, 407. 00	2. 49
392	603369	今世缘	3, 480, 754. 00	2. 49
393	605399	晨光新材	3, 466, 557. 00	2. 48
394	002901	大博医疗	3, 454, 184. 00	2. 48
395	300409	道氏技术	3, 437, 981. 00	2. 46
396	600967	内蒙一机	3, 417, 349. 00	2. 45
397	002833	弘亚数控	3, 415, 362. 20	2. 45
398	603876	鼎胜新材	3, 408, 195. 00	2. 44
399	600377	宁沪高速	3, 389, 682. 00	2. 43
400	601898	中煤能源	3, 384, 385. 00	2. 43
401	688200	华峰测控	3, 369, 103. 03	2. 41
402	600372	中航电子	3, 367, 682. 00	2. 41
403	603833	欧派家居	3, 344, 618. 00	2. 40

404	600369	西南证券	3, 340, 896. 00	2. 39
405	603610	麒盛科技	3, 312, 433. 00	2. 37
406	601985	中国核电	3, 301, 648. 00	2. 37
407	300196	长海股份	3, 296, 510. 00	2. 36
408	603612	索通发展	3, 277, 824. 40	2. 35
409	600176	中国巨石	3, 264, 912. 00	2. 34
410	600415	小商品城	3, 244, 062. 39	2. 32
411	600729	重庆百货	3, 237, 805. 54	2. 32
412	600584	长电科技	3, 228, 982. 00	2. 31
413	002545	东方铁塔	3, 207, 795. 00	2. 30
414	003035	南网能源	3, 188, 132. 35	2. 28
415	601088	中国神华	3, 164, 496. 00	2. 27
416	300171	东富龙	3, 161, 715. 00	2. 27
417	002748	世龙实业	3, 160, 460. 00	2. 26
418	601211	国泰君安	3, 157, 250. 00	2. 26
419	000822	山东海化	3, 149, 531. 00	2. 26
420	000656	金科股份	3, 135, 040. 00	2. 25
421	600845	宝信软件	3, 128, 758. 00	2. 24
422	300457	赢合科技	3, 122, 671. 00	2. 24
423	300101	振芯科技	3, 106, 136. 00	2. 23
424	300623	捷捷微电	3, 088, 579. 00	2. 21
425	600827	百联股份	3, 079, 580. 00	2. 21
426	600309	万华化学	3, 054, 218. 56	2. 19
427	300007	汉威科技	3, 049, 240. 00	2. 19
428	300260	新莱应材	3, 048, 780. 00	2. 18
429	300638	广和通	3, 048, 231. 92	2. 18
430	000683	远兴能源	3, 044, 674. 00	2. 18
431	300271	华宇软件	3, 030, 715. 00	2. 17
432	002236	大华股份	2, 974, 591. 00	2. 13
433	000031	大悦城	2, 972, 278. 00	2. 13
434	600339	中油工程	2, 962, 232. 00	2. 12

435	600639	浦东金桥	2, 947, 509. 00	2. 11
436	000949	新乡化纤	2, 944, 805. 00	2. 11
437	601618	中国中冶	2, 908, 940. 00	2. 08
438	002384	东山精密	2, 900, 069. 00	2. 08
439	300055	万邦达	2, 897, 335. 00	2. 08
440	002858	力盛赛车	2, 891, 396. 00	2. 07
441	002409	雅克科技	2, 889, 297. 00	2. 07
442	603033	三维股份	2, 888, 801. 40	2. 07
443	300358	楚天科技	2, 878, 770. 00	2. 06
444	600879	航天电子	2, 871, 359. 00	2. 06
445	300073	当升科技	2, 856, 573. 00	2. 05
446	002429	兆驰股份	2, 855, 927. 00	2. 05
447	300587	天铁股份	2, 848, 705. 84	2. 04
448	002978	安宁股份	2, 847, 733. 00	2. 04
449	001979	招商蛇口	2, 845, 019. 00	2. 04
450	002281	光迅科技	2, 837, 091. 00	2. 03
451	000725	京东方 A	2, 835, 795. 00	2. 03
452	603236	移远通信	2, 832, 490. 60	2. 03
453	002653	海思科	2, 814, 725. 00	2. 02
454	603986	兆易创新	2, 808, 734. 60	2. 01
455	002643	万润股份	2, 796, 541. 00	2. 00

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	603256	宏和科技	16, 928, 452. 04	12. 13
2	600546	山煤国际	16, 276, 589. 99	11. 66
3	688208	道通科技	15, 947, 451. 99	11. 43
4	300316	晶盛机电	15, 940, 833. 93	11. 42
5	002458	益生股份	15, 743, 732. 00	11. 28

6	601128	常熟银行	15, 246, 882. 00	10. 93
7	600808	马钢股份	14, 738, 351. 00	10. 56
8	600141	兴发集团	14, 676, 211. 20	10. 52
9	002648	卫星化学	14, 603, 192. 60	10. 46
10	600089	特变电工	14, 337, 503. 36	10. 27
11	000732	泰禾集团	13, 917, 042. 00	9. 97
12	603198	迎驾贡酒	13, 915, 821. 00	9. 97
13	002092	中泰化学	13, 832, 958. 00	9. 91
14	000807	云铝股份	13, 714, 689. 08	9. 83
15	600282	南钢股份	13, 696, 823. 00	9. 81
16	000983	山西焦煤	13, 626, 275. 54	9. 76
17	600582	天地科技	13, 343, 742. 00	9. 56
18	002867	周大生	13, 338, 554. 13	9. 56
19	000519	中兵红箭	13, 315, 873. 55	9. 54
20	002004	华邦健康	13, 295, 873. 27	9. 53
21	600782	新钢股份	13, 022, 876. 75	9. 33
22	000825	太钢不锈	12, 985, 872. 10	9. 31
23	300168	万达信息	12, 985, 381. 00	9. 31
24	600008	首创股份	12, 597, 373. 79	9. 03
25	600755	厦门国贸	12, 558, 197. 80	9. 00
26	600765	中航重机	12, 543, 688. 04	8. 99
27	600348	阳泉煤业	12, 479, 956. 80	8. 94
28	601098	中南传媒	12, 367, 898. 37	8. 86
29	002701	奥瑞金	12, 296, 610. 00	8. 81
30	002244	滨江集团	12, 233, 476. 83	8. 77
31	000729	燕京啤酒	12, 227, 838. 80	8. 76
32	600153	建发股份	12, 123, 930. 01	8. 69
33	000636	风华高科	12, 078, 808. 52	8. 66
34	002839	张家港行	12, 067, 270. 55	8. 65
35	002408	齐翔腾达	12, 014, 590. 66	8. 61
36	600787	中储股份	11, 944, 413. 00	8. 56

37	000898	鞍钢股份	11,817,396.05	8.47
38	002416	爱施德	11,799,167.60	8.46
39	600985	淮北矿业	11,774,375.25	8.44
40	002396	星网锐捷	11,696,638.20	8.38
41	000690	宝新能源	11,657,498.00	8.35
42	600039	四川路桥	11,487,664.12	8.23
43	601233	桐昆股份	11,483,592.00	8.23
44	600373	中文传媒	11,451,800.00	8.21
45	600884	杉杉股份	11,446,353.13	8.20
46	601598	中国外运	11,316,911.00	8.11
47	002368	太极股份	11,303,831.38	8.10
48	000932	华菱钢铁	11,239,751.00	8.05
49	601689	拓普集团	11,172,084.54	8.01
50	000887	中鼎股份	11,078,766.82	7.94
51	000970	中科三环	10,972,134.00	7.86
52	601636	旗滨集团	10,901,919.00	7.81
53	300296	利亚德	10,899,697.22	7.81
54	000009	中国宝安	10,894,219.25	7.81
55	002013	中航机电	10,782,459.52	7.73
56	000830	鲁西化工	10,740,377.00	7.70
57	600256	广汇能源	10,705,132.00	7.67
58	002110	三钢闽光	10,688,472.50	7.66
59	600516	方大炭素	10,680,271.39	7.65
60	000937	冀中能源	10,636,068.30	7.62
61	603885	吉祥航空	10,629,136.00	7.62
62	002080	中材科技	10,452,147.76	7.49
63	601969	海南矿业	10,270,048.00	7.36
64	600970	中材国际	10,254,530.58	7.35
65	600839	四川长虹	10,250,650.36	7.35
66	002138	顺络电子	10,177,795.81	7.29
67	000717	韶钢松山	10,098,515.00	7.24

68	002434	万里扬	10,094,615.70	7.23
69	002048	宁波华翔	10,051,037.50	7.20
70	002268	卫士通	10,030,937.00	7.19
71	001914	招商积余	10,010,903.00	7.17
72	002557	洽洽食品	9,995,794.52	7.16
73	002572	索菲亚	9,986,261.48	7.16
74	600060	海信视像	9,981,904.20	7.15
75	300474	景嘉微	9,901,843.15	7.10
76	603355	莱克电气	9,897,308.00	7.09
77	600409	三友化工	9,854,564.00	7.06
78	600188	兖州煤业	9,847,969.00	7.06
79	002128	电投能源	9,814,424.00	7.03
80	300001	特锐德	9,813,058.00	7.03
81	603883	老百姓	9,810,546.13	7.03
82	603379	三美股份	9,706,599.38	6.96
83	600315	上海家化	9,670,609.92	6.93
84	002563	森马服饰	9,630,649.38	6.90
85	601512	中新集团	9,545,876.00	6.84
86	600398	海澜之家	9,508,089.00	6.81
87	601615	明阳智能	9,465,951.00	6.78
88	603156	养元饮品	9,454,380.00	6.77
89	601699	潞安环能	9,452,861.58	6.77
90	300146	汤臣倍健	9,420,539.94	6.75
91	000999	华润三九	9,348,102.95	6.70
92	000156	华数传媒	9,318,300.00	6.68
93	601928	凤凰传媒	9,227,091.00	6.61
94	600737	中粮糖业	9,052,013.00	6.49
95	002745	木林森	9,010,554.73	6.46
96	603613	国联股份	9,006,601.44	6.45
97	601117	中国化学	9,002,551.00	6.45
98	601139	深圳燃气	8,999,590.00	6.45

99	601127	小康股份	8,986,682.32	6.44
100	002390	信邦制药	8,983,985.42	6.44
101	600350	山东高速	8,974,230.50	6.43
102	002946	新乳业	8,969,811.15	6.43
103	600500	中化国际	8,969,287.80	6.43
104	600038	中直股份	8,948,120.30	6.41
105	600219	南山铝业	8,947,157.00	6.41
106	601068	中铝国际	8,856,351.00	6.35
107	601717	郑煤机	8,638,260.68	6.19
108	603638	艾迪精密	8,604,474.20	6.17
109	000415	渤海租赁	8,593,022.84	6.16
110	002266	浙富控股	8,567,819.00	6.14
111	002465	海格通信	8,565,421.00	6.14
112	600171	上海贝岭	8,520,038.00	6.11
113	603225	新凤鸣	8,518,485.57	6.10
114	601869	长飞光纤	8,472,618.22	6.07
115	000959	首钢股份	8,382,042.00	6.01
116	000537	广宇发展	8,353,774.81	5.99
117	002183	怡亚通	8,346,344.90	5.98
118	600637	东方明珠	8,317,489.89	5.96
119	601333	广深铁路	8,312,319.00	5.96
120	000012	南玻A	8,281,026.08	5.93
121	603589	口子窖	8,243,482.39	5.91
122	600460	士兰微	8,239,791.20	5.90
123	600497	驰宏锌锗	8,196,691.70	5.87
124	600663	陆家嘴	8,182,464.98	5.86
125	002185	华天科技	8,159,928.72	5.85
126	002372	伟星新材	8,104,854.00	5.81
127	300010	豆神教育	8,045,598.00	5.77
128	300182	捷成股份	8,016,263.00	5.74
129	000998	隆平高科	7,941,582.00	5.69

130	300618	寒锐钴业	7, 933, 007. 40	5. 68
131	600418	江淮汽车	7, 898, 067. 00	5. 66
132	002191	劲嘉股份	7, 896, 816. 00	5. 66
133	000960	锡业股份	7, 850, 632. 00	5. 63
134	600754	锦江酒店	7, 850, 344. 00	5. 63
135	300383	光环新网	7, 839, 206. 00	5. 62
136	601828	美凯龙	7, 817, 243. 25	5. 60
137	002532	天山铝业	7, 796, 516. 00	5. 59
138	002705	新宝股份	7, 792, 766. 00	5. 58
139	000685	中山公用	7, 791, 768. 00	5. 58
140	603786	科博达	7, 790, 860. 00	5. 58
141	000988	华工科技	7, 744, 462. 00	5. 55
142	300207	欣旺达	7, 732, 166. 43	5. 54
143	600885	宏发股份	7, 721, 235. 50	5. 53
144	002174	游族网络	7, 706, 856. 00	5. 52
145	600131	国网信通	7, 634, 708. 46	5. 47
146	600642	申能股份	7, 602, 619. 71	5. 45
147	002155	湖南黄金	7, 587, 760. 22	5. 44
148	300699	光威复材	7, 508, 141. 80	5. 38
149	003022	联泓新科	7, 342, 912. 08	5. 26
150	601778	晶科科技	7, 333, 619. 00	5. 26
151	002212	天融信	7, 324, 493. 80	5. 25
152	000778	新兴铸管	7, 304, 993. 27	5. 23
153	000598	兴蓉环境	7, 295, 399. 00	5. 23
154	300482	万孚生物	7, 281, 223. 80	5. 22
155	002505	鹏都农牧	7, 273, 957. 00	5. 21
156	002506	协鑫集成	7, 233, 988. 00	5. 18
157	603650	彤程新材	7, 219, 249. 00	5. 17
158	600959	江苏有线	7, 203, 835. 00	5. 16
159	600968	海油发展	7, 186, 634. 30	5. 15
160	000681	视觉中国	7, 181, 634. 26	5. 15

161	603377	东方时尚	7, 154, 109. 01	5. 13
162	002985	北摩高科	7, 112, 141. 70	5. 10
163	600739	辽宁成大	7, 086, 551. 00	5. 08
164	600160	巨化股份	7, 073, 864. 50	5. 07
165	002444	巨星科技	7, 056, 017. 80	5. 06
166	600563	法拉电子	7, 054, 588. 00	5. 06
167	300630	普利制药	7, 045, 045. 96	5. 05
168	600390	五矿资本	6, 983, 089. 34	5. 00
169	603260	合盛硅业	6, 964, 912. 00	4. 99
170	000039	中集集团	6, 958, 141. 00	4. 99
171	002223	鱼跃医疗	6, 931, 642. 71	4. 97
172	300166	东方国信	6, 924, 407. 00	4. 96
173	603927	中科软	6, 882, 305. 42	4. 93
174	002690	美亚光电	6, 864, 586. 22	4. 92
175	601298	青岛港	6, 844, 186. 00	4. 90
176	600733	北汽蓝谷	6, 835, 260. 03	4. 90
177	002156	通富微电	6, 809, 687. 55	4. 88
178	600027	华电国际	6, 787, 960. 00	4. 86
179	600956	新天绿能	6, 738, 954. 00	4. 83
180	000733	振华科技	6, 697, 337. 00	4. 80
181	002028	思源电气	6, 687, 528. 00	4. 79
182	600875	东方电气	6, 668, 233. 12	4. 78
183	600466	蓝光发展	6, 653, 174. 20	4. 77
184	600549	厦门钨业	6, 629, 601. 00	4. 75
185	000501	鄂武商 A	6, 621, 275. 90	4. 74
186	002074	国轩高科	6, 619, 550. 00	4. 74
187	000930	中粮科技	6, 613, 341. 49	4. 74
188	600426	华鲁恒升	6, 596, 783. 80	4. 73
189	000046	泛海控股	6, 595, 252. 00	4. 73
190	601992	金隅集团	6, 572, 350. 14	4. 71
191	000739	普洛药业	6, 566, 660. 57	4. 71

192	000060	中金岭南	6, 536, 546. 18	4. 68
193	002382	蓝帆医疗	6, 526, 718. 48	4. 68
194	000050	深天马 A	6, 502, 312. 99	4. 66
195	000581	威孚高科	6, 470, 190. 41	4. 64
196	603893	瑞芯微	6, 469, 874. 01	4. 64
197	600901	江苏租赁	6, 434, 346. 00	4. 61
198	000400	许继电气	6, 434, 171. 00	4. 61
199	002010	传化智联	6, 380, 731. 00	4. 57
200	603816	顾家家居	6, 376, 761. 14	4. 57
201	300244	迪安诊断	6, 364, 759. 25	4. 56
202	300002	神州泰岳	6, 355, 499. 60	4. 55
203	000961	中南建设	6, 311, 605. 00	4. 52
204	600623	华谊集团	6, 258, 518. 89	4. 48
205	601456	国联证券	6, 192, 925. 00	4. 44
206	000883	湖北能源	6, 191, 282. 96	4. 44
207	002709	天赐材料	6, 149, 387. 80	4. 41
208	002317	众生药业	6, 142, 031. 01	4. 40
209	600329	中新药业	6, 103, 077. 00	4. 37
210	600325	华发股份	6, 062, 967. 00	4. 34
211	002818	富森美	5, 992, 943. 00	4. 29
212	600026	中远海能	5, 976, 962. 46	4. 28
213	002353	杰瑞股份	5, 941, 184. 47	4. 26
214	002831	裕同科技	5, 938, 023. 60	4. 26
215	300212	易华录	5, 921, 770. 00	4. 24
216	300251	光线传媒	5, 915, 591. 00	4. 24
217	000559	万向钱潮	5, 891, 323. 40	4. 22
218	600258	首旅酒店	5, 874, 952. 00	4. 21
219	600908	无锡银行	5, 867, 747. 78	4. 20
220	002387	维信诺	5, 843, 986. 00	4. 19
221	300072	三聚环保	5, 818, 709. 07	4. 17
222	002299	圣农发展	5, 796, 267. 00	4. 15

223	002925	盈趣科技	5, 792, 706. 59	4. 15
224	300012	华测检测	5, 702, 689. 72	4. 09
225	002250	联化科技	5, 680, 484. 00	4. 07
226	600177	雅戈尔	5, 671, 985. 29	4. 06
227	002056	横店东磁	5, 671, 924. 00	4. 06
228	600667	太极实业	5, 660, 578. 56	4. 06
229	000869	张 裕 A	5, 640, 614. 00	4. 04
230	603568	伟明环保	5, 634, 961. 12	4. 04
231	605358	立昂微	5, 634, 700. 00	4. 04
232	688088	虹软科技	5, 619, 159. 86	4. 03
233	000975	银泰黄金	5, 587, 584. 00	4. 00
234	600022	山东钢铁	5, 576, 257. 00	4. 00
235	601168	西部矿业	5, 553, 950. 92	3. 98
236	300009	安科生物	5, 538, 250. 40	3. 97
237	300357	我武生物	5, 518, 878. 00	3. 95
238	002683	广东宏大	5, 513, 290. 00	3. 95
239	600998	九州通	5, 481, 324. 58	3. 93
240	002273	水晶光电	5, 466, 673. 00	3. 92
241	603868	飞科电器	5, 433, 318. 34	3. 89
242	603712	七一二	5, 433, 136. 00	3. 89
243	603605	珀莱雅	5, 399, 813. 00	3. 87
244	601966	玲珑轮胎	5, 399, 686. 65	3. 87
245	002203	海亮股份	5, 395, 281. 66	3. 87
246	600820	隧道股份	5, 385, 463. 25	3. 86
247	600376	首开股份	5, 385, 312. 20	3. 86
248	002625	光启技术	5, 359, 545. 00	3. 84
249	600673	东阳光	5, 350, 344. 00	3. 83
250	300037	新宙邦	5, 339, 396. 00	3. 83
251	601668	中国建筑	5, 314, 557. 20	3. 81
252	601003	柳钢股份	5, 309, 531. 80	3. 80
253	603456	九洲药业	5, 306, 004. 50	3. 80

254	600170	上海建工	5, 284, 390. 94	3. 79
255	002926	华西证券	5, 265, 230. 00	3. 77
256	688321	微芯生物	5, 264, 980. 26	3. 77
257	600597	光明乳业	5, 213, 460. 00	3. 74
258	600649	城投控股	5, 197, 758. 98	3. 72
259	000990	诚志股份	5, 161, 327. 06	3. 70
260	600380	健康元	5, 145, 449. 04	3. 69
261	300308	中际旭创	5, 144, 866. 14	3. 69
262	002180	纳思达	5, 113, 295. 20	3. 66
263	603882	金域医学	5, 109, 198. 00	3. 66
264	601187	厦门银行	5, 108, 332. 92	3. 66
265	601881	中国银河	5, 093, 043. 00	3. 65
266	603317	天味食品	5, 085, 316. 39	3. 64
267	002439	启明星辰	5, 081, 112. 14	3. 64
268	000709	河钢股份	5, 061, 382. 00	3. 63
269	002507	涪陵榨菜	5, 056, 190. 16	3. 62
270	000513	丽珠集团	5, 035, 102. 20	3. 61
271	600917	重庆燃气	5, 022, 131. 00	3. 60
272	002568	百润股份	4, 980, 216. 80	3. 57
273	600707	彩虹股份	4, 979, 695. 00	3. 57
274	001872	招商港口	4, 973, 859. 28	3. 56
275	600307	酒钢宏兴	4, 962, 764. 00	3. 56
276	300750	宁德时代	4, 904, 360. 74	3. 51
277	600645	中源协和	4, 885, 081. 00	3. 50
278	000738	航发控制	4, 844, 379. 00	3. 47
279	601899	紫金矿业	4, 819, 351. 00	3. 45
280	603888	新华网	4, 782, 223. 52	3. 43
281	600312	平高电气	4, 773, 806. 00	3. 42
282	603707	健友股份	4, 768, 546. 40	3. 42
283	300253	卫宁健康	4, 750, 026. 00	3. 40
284	603866	桃李面包	4, 735, 193. 02	3. 39

285	603228	景旺电子	4,723,533.00	3.38
286	600580	卧龙电驱	4,682,835.00	3.36
287	002065	东华软件	4,675,379.00	3.35
288	601866	中远海发	4,654,816.78	3.34
289	002075	沙钢股份	4,641,460.00	3.33
290	603737	三棵树	4,633,684.00	3.32
291	002585	双星新材	4,604,065.22	3.30
292	002385	大北农	4,587,870.00	3.29
293	002078	太阳纸业	4,572,873.00	3.28
294	002064	华峰化学	4,571,642.00	3.28
295	603515	欧普照明	4,557,263.52	3.27
296	002422	科伦药业	4,551,862.00	3.26
297	300257	开山股份	4,531,307.00	3.25
298	300382	斯莱克	4,528,780.45	3.25
299	002375	亚厦股份	4,522,910.00	3.24
300	600803	新奥股份	4,490,976.00	3.22
301	600699	均胜电子	4,442,979.00	3.18
302	002423	中粮资本	4,441,605.44	3.18
303	000686	东北证券	4,433,349.60	3.18
304	300223	北京君正	4,429,977.76	3.17
305	600486	扬农化工	4,415,497.14	3.16
306	002738	中矿资源	4,365,576.00	3.13
307	002756	永兴材料	4,343,872.89	3.11
308	600779	水井坊	4,342,504.00	3.11
309	601857	中国石油	4,324,658.00	3.10
310	300059	东方财富	4,280,020.00	3.07
311	002221	东华能源	4,263,848.74	3.06
312	002500	山西证券	4,251,254.00	3.05
313	600053	九鼎投资	4,241,886.16	3.04
314	600201	生物股份	4,213,991.00	3.02
315	002901	大博医疗	4,185,066.00	3.00

316	002511	中顺洁柔	4, 175, 740. 77	2. 99
317	002146	荣盛发展	4, 172, 190. 00	2. 99
318	300413	芒果超媒	4, 145, 411. 60	2. 97
319	600297	广汇汽车	4, 126, 987. 40	2. 96
320	600216	浙江医药	4, 124, 127. 00	2. 96
321	601198	东兴证券	4, 114, 136. 00	2. 95
322	600511	国药股份	4, 107, 830. 00	2. 94
323	600643	爱建集团	4, 105, 204. 53	2. 94
324	600690	海尔智家	4, 096, 990. 00	2. 94
325	000062	深圳华强	4, 086, 808. 65	2. 93
326	300463	迈克生物	4, 040, 162. 55	2. 90
327	000021	深科技	4, 037, 584. 52	2. 89
328	600126	杭钢股份	4, 034, 168. 00	2. 89
329	300294	博雅生物	4, 027, 941. 00	2. 89
330	600372	中航电子	3, 999, 834. 00	2. 87
331	600871	石化油服	3, 970, 197. 65	2. 84
332	601958	金钼股份	3, 954, 196. 00	2. 83
333	603897	长城科技	3, 948, 764. 00	2. 83
334	601577	长沙银行	3, 933, 515. 00	2. 82
335	300418	昆仑万维	3, 928, 418. 00	2. 82
336	002241	歌尔股份	3, 925, 656. 00	2. 81
337	600867	通化东宝	3, 921, 582. 80	2. 81
338	300568	星源材质	3, 907, 951. 70	2. 80
339	688002	睿创微纳	3, 842, 817. 72	2. 75
340	002601	龙佰集团	3, 838, 139. 00	2. 75
341	600823	世茂股份	3, 831, 126. 76	2. 75
342	002765	蓝黛科技	3, 791, 367. 00	2. 72
343	601179	中国西电	3, 789, 326. 00	2. 72
344	300409	道氏技术	3, 770, 362. 90	2. 70
345	600862	中航高科	3, 752, 716. 00	2. 69
346	002294	信立泰	3, 749, 842. 52	2. 69

347	601118	海南橡胶	3,743,409.00	2.68
348	603876	鼎胜新材	3,716,445.00	2.66
349	605399	晨光新材	3,707,688.00	2.66
350	601155	新城控股	3,680,691.00	2.64
351	600704	物产中大	3,680,183.00	2.64
352	300457	赢合科技	3,662,147.00	2.62
353	002493	荣盛石化	3,657,376.00	2.62
354	600827	百联股份	3,651,694.91	2.62
355	603719	良品铺子	3,651,368.00	2.62
356	600928	西安银行	3,649,614.22	2.62
357	600259	广晟有色	3,634,143.00	2.60
358	600369	西南证券	3,599,236.64	2.58
359	600909	华安证券	3,597,082.10	2.58
360	000799	酒鬼酒	3,591,515.70	2.57
361	002966	苏州银行	3,584,793.00	2.57
362	300115	长盈精密	3,562,827.00	2.55
363	601568	北元集团	3,494,908.00	2.50
364	300035	中科电气	3,469,450.00	2.49
365	000977	浪潮信息	3,442,589.44	2.47
366	300324	旋极信息	3,414,558.00	2.45
367	600392	盛和资源	3,411,275.00	2.44
368	000623	吉林敖东	3,403,362.23	2.44
369	603115	海星股份	3,396,882.00	2.43
370	002833	弘亚数控	3,378,186.00	2.42
371	300741	华宝股份	3,376,615.00	2.42
372	601880	大连港	3,356,927.50	2.41
373	002233	塔牌集团	3,349,205.00	2.40
374	600895	张江高科	3,346,571.00	2.40
375	000568	泸州老窖	3,340,887.00	2.39
376	002249	大洋电机	3,318,187.86	2.38
377	600377	宁沪高速	3,294,089.00	2.36

378	601985	中国核电	3, 282, 767. 00	2. 35
379	601898	中煤能源	3, 282, 495. 00	2. 35
380	000027	深圳能源	3, 281, 881. 00	2. 35
381	600879	航天电子	3, 270, 539. 00	2. 34
382	600123	兰花科创	3, 261, 044. 00	2. 34
383	603599	广信股份	3, 253, 627. 00	2. 33
384	300260	新莱应材	3, 218, 875. 00	2. 31
385	003035	南网能源	3, 201, 752. 70	2. 29
386	600845	宝信软件	3, 200, 006. 40	2. 29
387	300196	长海股份	3, 198, 003. 00	2. 29
388	300101	振芯科技	3, 195, 254. 00	2. 29
389	601211	国泰君安	3, 178, 170. 00	2. 28
390	688200	华峰测控	3, 175, 596. 59	2. 28
391	002152	广电运通	3, 156, 225. 00	2. 26
392	600584	长电科技	3, 148, 493. 00	2. 26
393	603612	索通发展	3, 147, 579. 00	2. 26
394	600801	华新水泥	3, 143, 330. 24	2. 25
395	603056	德邦股份	3, 125, 412. 00	2. 24
396	300055	万邦达	3, 099, 885. 00	2. 22
397	002748	世龙实业	3, 085, 724. 00	2. 21
398	300363	博腾股份	3, 076, 072. 00	2. 20
399	000656	金科股份	3, 046, 248. 00	2. 18
400	000683	远兴能源	3, 032, 168. 00	2. 17
401	000822	山东海化	3, 022, 573. 00	2. 17
402	603806	福斯特	3, 014, 882. 00	2. 16
403	600309	万华化学	3, 009, 739. 00	2. 16
404	300638	广和通	3, 008, 840. 00	2. 16
405	002236	大华股份	2, 995, 920. 50	2. 15
406	300007	汉威科技	2, 988, 165. 00	2. 14
407	603688	石英股份	2, 985, 634. 49	2. 14
408	601555	东吴证券	2, 983, 806. 00	2. 14

409	601618	中国中冶	2,947,330.00	2.11
410	002430	杭氧股份	2,936,641.00	2.10
411	600507	方大特钢	2,923,336.74	2.09
412	300390	天华超净	2,922,908.00	2.09
413	002281	光迅科技	2,916,502.32	2.09
414	002019	亿帆医药	2,915,475.00	2.09
415	603236	移远通信	2,900,795.60	2.08
416	603517	绝味食品	2,897,206.00	2.08
417	001979	招商蛇口	2,876,107.57	2.06
418	300777	中简科技	2,866,944.00	2.05
419	000630	铜陵有色	2,818,901.00	2.02
420	000949	新乡化纤	2,818,416.00	2.02
421	002858	力盛赛车	2,818,251.00	2.02
422	002643	万润股份	2,803,212.00	2.01
423	002429	兆驰股份	2,797,057.00	2.00

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	4,249,894,470.37
卖出股票收入（成交）总额	3,772,072,378.02

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,531.44
5	应收申购款	1,721,157.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,735,688.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
中信 建投 中证5 00增 强A	11,962	16,192.77	31,609,582.86	16.3190%	162,088,297.14	83.6810%
中信 建投 中证5 00增 强C	13,930	16,722.63	75,051,155.45	32.2182%	157,895,072.40	67.7818%
合计	25,437	16,772.58	106,660,738.31	24.9999%	319,983,369.54	75.0001%

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	中信建投中证500	221,226.29	0.1142%

持有本基金	增强A		
	中信建投中证500 增强C	44,221.01	0.0190%
	合计	265,447.30	0.0622%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证500增强A	中信建投中证500增强C
基金合同生效日(2020年05月09 日)基金份额总额	109,947,302.18	162,449,314.06
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	295,124,497.10	502,724,769.90
减：本报告期基金总赎回份额	163,703,104.05	314,498,156.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,697,880.00	232,946,227.85

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

2021年9月17日，张乐久先生不再担任基金管理人督察长，总经理金强先生代行督察长职务。

2021年11月18日，朱伟先生担任基金管理人督察长，总经理金强先生不再代行督察长职务。

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。

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

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元整，该审计机构自2020年5月9日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	2	8,008,595,816.58	100.00%	5,829,690.30	100.00%	-

商柜台)						
------	--	--	--	--	--	--

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相关部门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）权益投资相关部门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。权益投资相关部门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%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门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。

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

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	规定报刊、规定网站	2021-01-21

	动的公告		
4	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
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	规定报刊、规定网站	2021-05-19

	联方承销证券的公告		
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-20
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	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
29	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
30	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
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	2021-07-03
32	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金投资关	规定报刊、规定网站	2021-07-14

	联方承销证券的公告		
33	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2021-07-21
34	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年第2季度报告	规定网站	2021-07-21
35	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加联储证券有限责任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	2021-07-22
36	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	2021-07-22
37	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	2021-07-23
38	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	2021-07-24
39	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券股份有限公司调整定投起点金额的公告	规定报刊、规定网站	2021-07-24
40	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金开展直销机构申购（含定投）业务费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-07-24
41	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-07-24

42	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	2021-07-28
43	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳市新兰德证券投资咨询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	2021-07-28
44	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	2021-07-29
45	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	2021-08-07
46	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加京东肯特瑞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	2021-08-10
47	关于调整中信建投中证500指数增强型证券投资基金在北京蛋卷基金销售有限公司申购及定投金额起点的公告	规定报刊、规定网站	2021-08-12
48	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	2021-08-14
49	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加北京汇成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	2021-08-17
50	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	2021-08-18

51	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加珠海盈米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	2021-08-19
52	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	2021-08-19
53	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	2021-08-26
54	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告提示性公告	规定报刊	2021-08-31
55	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年中期报告	规定网站	2021-08-31
56	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	2021-09-01
57	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加上海长量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	2021-09-02
58	中信建投中证500指数增强型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）公告	规定报刊、规定网站	2021-09-03
59	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加东北证券股份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	2021-09-03

60	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	2021-09-04
61	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	2021-09-08
62	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加北京恒天明泽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	2021-09-09
63	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	2021-09-11
64	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司认、申购及定投金额起点的公告	规定报刊、规定网站	2021-09-14
65	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京广源达信基金销售有限公司为代销机构并调整认购、申购起点金额、开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-10-15
66	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	2021-10-16
67	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	2021-10-20
68	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	2021-10-21

69	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	2021-10-21
70	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	2021-10-22
71	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2021-10-27
72	中信建投中证500指数增强型证券投资基金2021年第3季度报告	规定网站	2021-10-27
73	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	2021-11-19
74	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	2021-11-20
75	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	2021-12-04
76	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	2021-12-10
77	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（一）	规定报刊、规定网站	2021-12-11
78	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（二）	规定报刊、规定网站	2021-12-11
79	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并开通定期定额	规定报刊、规定网站	2021-12-13

	投资业务的公告		
80	中信建投基金管理有限公司关于变更客服邮箱的公告	规定报刊、规定网站	2021-12-18
81	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	2021-12-18
82	关于中信建投中证500指数增强型证券投资基金增加中国中金财富证券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	2021-12-20

§ 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
机构	1	20210318-20210608	-	22,103,595.64	22,103,595.64	-	-
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日