

B084 信息披露 | Disclosure

中金中证500指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

重要提示

中金中证500指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请于2016年7月5日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[2016]1517号《关于准予中金中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，并于 2016年7月22日经中国证监会证券投资基金机构监管部函函[2016]1701号《关于中金中证500指数增强型发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2016年7月22日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的的投资价值和市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场及期货市场，基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、税负增加风险、其他风险等。本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于证券投资基金中高风险品种和高风险预期收益的品种。

本基金可投资科创板股票，科创板股票的主要风险包括但不限于流动性风险、停牌、退市风险、投资集中度风险、参与战略配售股票风险等。

本基金基金份额分为A、C两类，其中A类基金份额收取认/申购费，C类基金份额不收取申购费，但计提销售服务费；A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面了解本基金的的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认/申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2020年7月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人：楚钢
成立时间：2014年2月10日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监许[2014]897号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币4亿元
存续期间：持续经营
股东：张煜
联系电话：010-63211122
公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
楚钢先生，董事长，理论物理学博士，特许金融分析师，历任花旗集团副总裁、新兴市场风控经理，地方政府债券自营交易员、基金经理，拉丁美洲股票期权交易负责人及另类投资董事总经理等职务，现任中国国际金融股份有限公司首席运营官、管理委员会委员。黄剑峰先生，董事，机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所（英国及香港）、审计、核算员、见习、副经理，经理等职务；香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务；高盛（亚洲），高盛集团（日本东京）固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人，日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人，执行董事等职务；北京高华证券有限责任公司中后台风控、风险管理岗位；高盛（亚洲）有限责任公司资产管理部亚太区首席运营官、亚太（除日本）首席运营官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、管理委员会成员。
徐迈成先生，董事，金融学硕士。历任中国国际金股份有限公司投资银行部收购兼并和财务顾问组负责人；总裁助理，战略发展部负责人、董事会秘书、综合办公室、战略发展部负责人。现任中国国际金股份有限公司总裁助理，资产管理板块负责人。
孙菁女士，董事，管理学硕士。历任中国国际金股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

赵毅先生，董事，经济学硕士。历任中国国际金股份有限公司投资银行部副经理；中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。
汤歆女士，董事，管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理；华安基金管理有限公司零售业务部副经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。
冒大卫先生，独立董事，哲学博士。历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记，北京大学医学部副主任、财务部部长，北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司董事、总裁，北京神州泰岳智能数据技术有限公司董事长，东莞市星辰信息技术有限公司监事，三亚迈普科技有限公司董事，北京新媒体信科技术有限公司执行董事，北京启天同信科技有限公司董事，北京科兴生物制品有限公司董事，鼎富智能科技有限公司董事长。
王元先生，独立董事，法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师事务所、北京市嘉源律师事务所上海分所律师。现任北京市嘉源律师事务所高级合伙人、管委会成员，兼任上海思华科技股份有限公司独立董事。
江勇先生，独立董事，经济学硕士。历任中国国际金股份有限公司投资银行部执行总经理、董事总经理，公司管理委员会成员、顾问董事。现任中国国际金融美国证券有限公司外部管理顾问。

2.基金管理人监事
白嫚女士，执行/监事，管理学硕士。历任航天信息股份有限公司内审部审计主管、长盛基金管理有限公司基金会计；中国国际金股份有限公司资产管理部高级经理。现任中金基金管理有限公司基金运营部负责人。
3.基金管理人高级管理人员
楚钢先生，董事长，简历同上。
孙菁女士，总经理，简历同上。
汤歆女士，副总经理，简历同上。
邱延冰先生，经济学博士。历任国家外汇管理局中央外汇业务中心战略研究处研究员、投资一处投资经理，投资二处副处长、处长（期间外派香港华安投资有限公司，担任副总经理兼财务总监）；丝路基金有限责任公司投资决策委员会委员，研究部副总监（主持工作）；和泰人寿保险股份有限公司总经理助理（兼资产管理部总经理）、董事会秘书。现任中金基金管理有限公司副总经理，基金经理。
李虹女士，督察长，法学硕士。历任美国达律律师事务所北京代表处律师；中国国际金股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。
夏静女士，理学硕士。历任普华永道（深圳）咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制部部副经理；中国国际金股份有限公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司稽核信贷、风险管理部负责人。

4.基金基金经理
魏学先生，统计学博士。2010年8月至2014年10月，在北京嘉源资产管理有限公司从事A股量化策略开发。2014年11月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公券投资部基金经理。
5.投资风控委员会成员
孙菁女士，管理学硕士。简历同上。
赵壁先生，经济学硕士。简历同上。
邱延冰先生，经济学博士。简历同上。
石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员；天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员；中国国际金股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理，投资经理。2016年7月加入中金基金管理有限公司，现任投资管理部基金投资。

朱宝臣先生，理学硕士。历任中国国际金股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017年10月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资团队负责人。
董珊珊女士，工商管理硕士。历任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理，投资经理，现任中金基金管理有限公司投资管理部基金投资。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街56号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：陈四清
注册资本：人民币35,640,625,708.9万元
联系电话：010-66106799
联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2020年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构
（1）直销柜台
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人：楚钢
电话：010-63211122
传真：010-66159121
联系人：张昱
客户服务电话：400-968-1166
网站：www.ciccfund.com
（2）网上直销
交易系统：中金基金网上交易系统
交易系统网址：trade.ciccfund.com
2.其他销售机构
（1）中国中金财富证券有限公司
网站：http://www.china-invs.cn
电话：400-600-8009、95532
（2）上海聚泰基金销售有限公司
网站：http://www.661antai.com/；
电话：400-118-1188
（3）平安证券股份有限公司
网站：www.stock.pingan.com
电话：95511-8
（4）上海好买基金销售有限公司
网站：www.howbuy.com
电话：400-700-9665
（5）上海万得基金销售有限公司
网站：http://www.520fund.com.cn
电话：400-821-0203
（6）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
网站：www.fund123.cn
电话：400-076-6123
（7）上海陆享投资管理有限公司
网站：http://www.luxxfund.com/；
电话：021-53389816
（8）长城证券股份有限公司
网站：www.cgws.com
电话：95514

（9）中国国际金融股份有限公司
网站：www.cicc.com
电话：010- 65051166
（10）中国银河证券股份有限公司
网站：www.chinastock.com.cn
电话：95551
（11）上海基煜基金销售有限公司
网站：www.jiyifund.com.cn
电话：400-820-5369
（12）和讯信息科技有限公司
网站：http://www.hexun.com/；
电话：400-159-9288
（13）北京展恒基金销售有限公司
网站：danjuanapp.com
电话：400-159-9288
（14）上海天天基金销售有限公司
网站：//fund.eastmoney.com/；
电话：95021
（15）上海搜投基金销售有限公司
网站：www.wacaijin.com
电话：021-50810673
（16）通华财富（上海）基金销售有限公司
电话：95156485
（17）洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
网站：www.hongtaiwealth.com
电话：400-8189-508
（18）北京唐鼎耀华基金销售有限公司
网站：www.tdyhfund.com
电话：400-819-9898
（19）北京特瑞财富投资管理有限公司
网站：http://tund.fic.com
电话：956118
（20）北京恒天明泽基金销售有限公司
网站：www.chtwm.com
电话：400-886-0618
（21）包商银行股份有限公司
网站：www.bsbchina.com
电话：95362
（22）北京植信基金销售有限公司
网站：www.zhixin-inv.com
客服电话：400-680-2123
（23）南京苏宁基金销售有限公司
网站：www.snjjin.com
电话：95177
（24）浙江同花顺基金销售有限公司
网站：www.5ifund.com
电话：4008-773-772
（25）济安财富（北京）基金销售有限公司
网站：http://www.jianfortune.com
电话：400-673-7010
（26）中信建投证券股份有限公司
网站：www.csc108.com
电话：400-888-8108
（27）珠海盈米基金销售有限公司
网站：www.yingmi.com
电话：020-89629099
（28）阳光人寿保险股份有限公司
网站：fund.sinosig.com
电话：95510
（29）上海长江基金销售投资顾问有限公司
网站：www.erichfund.com
电话：400-820-2899
（30）东方财富证券股份有限公司
网站：http://www.zxsec.com
电话：95357
（31）招商银行股份有限公司
网站：http://www.cmbchina.com/；
电话：95555
（32）腾安基金销售（深圳）有限公司
网站：https://www.txfund.com/；
电话：95017
（33）中信证券股份有限公司
网站：www.cs.ecitic.com
电话：95548
（34）中信证券（山东）有限责任公司
网站：http://srd.citics.com/；
电话：95548
（35）中信期货有限公司
网站：www.citicsf.com
电话：400-900-8826
（36）中银国际证券股份有限公司
网站：www.bocichina.com
电话：400-620-8888
（37）万家财富基金销售（天津）有限公司
网站：http://www.wanjiawealth.com/；
电话：010-59013895
（38）上海证券有限责任公司
网站：https://www.shzq.com/；
电话：4008-918-918
（39）中信证券华南股份有限公司
网站：http://www.gzsc.com.cn
电话：95396
（40）北京汇成基金销售有限公司
网站：www.hcjjin.com
电话：400-619-0069
（41）安信证券股份有限公司
网站：http://www.essence.com.cn
电话：95517
（42）江苏汇林保大基金销售有限公司
网站：http://www.huilinbd.com
电话：025-66046166
（二）登记机构
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人：楚钢
电话：010-63211122
传真：010-66155573
联系人：白嫚

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：北京市海润律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环中路6号财富金融中心C20层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路6号财富金融中心20层
负责人：张黎平
电话：(+86 10) 8560 6888
传真：(+86 10) 8560 6999
经办律师：魏双娟、高巍
联系人：李
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼层
办公地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼层
执行事务合伙人：邹俊
电话：010-85087916
传真：010-85189111
盖章注册会计师：张君一、丁时杰
联系人：程海良

四、基金的名称
中金中证500指数增强型发起式证券投资基金

五、基金的类型及运作方式

（一）基金的类型
股票型证券投资基金。

（二）基金的运作方式
契约开放式。

六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的风险组合管理，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差率不超过3.0%。

七、基金的投资方向

本基金投资范围主要标的为股票指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包括中小盘、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的90%－95%，投资于标的指数成分股及其备选成分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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（一）资产配置策略
本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资比例范围为基金资产的90%－96%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考虑系统性风险、各类资产收益风险特征、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。

（二）股票投资策略
本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资主要策略为标的指数的因子策略。通过定制目标指数成分股作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。

1.标的指数投资策略
指数化被动投资策略参照标的指数的成分股，备选成分股及其权重，初步构建投资组合，并按跟踪的指数的调整原则作出相应调整。

2.量化增强策略
量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。

基于模型结果，基金管理人结合市场环境 and 股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数的业绩水平。

多因子超额收益模型：本模型是基于市场不完全有效地假设，着眼于运用统计方法和金融理论发现证券预期收益的驱动因子以及他们之间的关系，利用历史数据回溯和构

建量化投资模型，预测并持有概率统计上有极大可能产生正收益的投资组合。预期收益的驱动因子可以和基本面对投资相同或类似，例如市盈率、资本市值、公司所处板块以及证券历史表现等，也可以是动量因子等技术面指标或者交易数量等流动性因子。
风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括基金规模、资产波动率、行业集中度等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内，使其收益需要符合指数收益特征。本模型主要通过控制和优化投资组合相对指数在一些风险因子上的偏离度来实现，常见风险因子如行业因子和基本面因子等。通过调整风险模型，本模型力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差率不超过3%。
成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花稅、佣金等数据测算基金的交易成本，调整基金的换手率，来达到优化投资组合的目的。

3.模型的应用与调整

在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场环境做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。

（三）债券投资策略
出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。

通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化及收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

（四）股指期货投资策略
本基金可投资股指期货。

本基金将依据股指期货合约，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。本基金为指数增强型基金，标的指数为中证500指数，因此业绩比较基准以中证500指数收益率为主要组成部分。

中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的大股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况。

本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征。如果指数编制单位停止计算该指数或今后法律法规发生变化或更改指数名称，或有更适当的、更为市场普遍接受业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

以下内容摘自中金中证500指数增强型发起式证券投资基金2020年第2季度报告。

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	108,896,096.33	89.82
	其中：股票	108,896,096.33	89.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,787,225.00	3.95
	其中：债券	4,787,225.00	3.95
	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	5,157,069.76	4.25
8	其他资产	2,403,374.98	1.98
9	合计	121,245,765.07	100.00

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	1,085,140.00	0.93
B	采矿业	1,735,611.00	1.49
C	制造业	53,892,971.50	46.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,601,577.00	3.94
E	建筑业	1,010,242.00	0.87
F	批发和零售业	8,181,953.60	7.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,778,957.00	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	8,462,941.16	7.25
J	金融业	5,779,843.40	4.95
K	房地产业	5,119,982.00	4.39
L	租赁和商务服务业	14,819.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	453,600.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,253,000.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	2,117,821.00	1.82
S	综合	754,608.00	0.65
	合计	97,243,066.66	83.35

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	186,537.12	0.16
B	采矿业	794,970.00	0.68
C	制造业	8,632,053.66	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	538,118.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,266,448.57	1.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	224,136.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,655,029.67	9.99

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	186,537.12	0.16
B	采矿业	794,970.00	0.68
C	制造业	8,632,053.66	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	538,118.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,266,448.57	1.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	224,136.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,655,029.67	9.99

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金未持有港股通投资股票。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

（1）报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	54,000	1,503,360.00	1.29
2	002439	启明旅辰	33,866	1,424,742.62	1.22
3	300088	长信科技	126,800	1,420,160.00	1.22
4	603444	吉比特	2,541	1,395,034.41	1.20
5	600298	安琪酵母	27,800	1,376,544.00	1.18
6	603939	益丰药房	13,800	1,255,800.00	1.08
7	603882	金域医学	14,000	1,253,000.00	1.07
8	603233	大参林	14,960	1,216,675.60	1.04
9	600885	安发股份	30,100	1,207,612.00	1.04
10	601799	厦钨股份	9,500	1,206,500.00	1.03

（2）报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300433	蓝思科技	30,900	866,436.00	0.74
2	601012	隆基股份	20,800	851,257.00	0.73
3	600809	山西汾酒	5,700	826,500.00	0.71
4	002916	浙南水电	4,900	820,948.00	0.70
5	300028	亿联网络	11,900	912,294.00	0.70

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

			(%)	
1	300433 蓝思科技	30,900	866,436.00	0.74
2	601012 隆基股份	20,900	851,257.00	0.73
3	600809 山西汾酒	5,700	826,500.00	0.71
4	002916 深南电路	4,900	820,848.00	0.70
5	300628 亿联网络	11,900	812,294.00	0.70

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,101,560.00	2.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,652,475.00	1.42
	其中：政策性金融债	1,652,475.00	1.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-