36,761.7

86,831.6

2,165,917.1

2,403,374.98

2-4

-0.109

0.03%

-0.099

-0.129

2-4

0.04%

0.03%

-0.099

-0.129

5.10%

6.92%

6.16%

8.66%

6.94%

6.21%

0.70%

7.77%

5.23%

7.74%

3.70%

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

か成し別水、企業立米が行目的収別以。 11.投资组合报告附注 (1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报

活成日期不以及人们自己基础设计,并且已经不行时的日期日日日 证确设设计 本报告期末,本基金末持有贵金属。 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末,本基金未持有权证

(1)本期国债期货投资政策

12. 其他资产构成

序号

本报告期末,本基金未持有股指期货。(2)本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末,本基金未持有国债期货

本报告期末,本基金未持有国债期货。 (3)本期国债期货投资评价

本报告期末,本基金未持有国债期货。

存出保证金

应收利息

待摊费用

阶段

2017年1日1日至20

19年1月1日至20 年12月31日

2020年1月1日至20

中金中证500C

阶段

2017年1月1日至201

2020年1月1日至20 年6月30日

(一)与基金运作有关的费用 1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费:

(3)C类份额的销售服务费

(8)基金的证券、期货交易费用

H=E×0.50% - 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

(2)基金托管人的托管费

. H=E×0.15%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费

H=E×0.40%÷当年天数 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

(4)基金合同生效后的指数许可使用费

年费率计提。计算方法如下: H=E×0.016% - 当年天数

计算方法如下:

(9)基金的银行汇划费用; (10)基金相关账户的开户及维护费用;

报告期末持有的外干转股期的可转换债券明细

14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券

13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

13. 报告别不削于石版等中存在低温文限情况的说明 (1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 报告期末,本基金指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

(2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明报告期末,本基金积极投资前五名股票不存在流通受限情况的说明报告期末,本基金积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

基金管理人依照恪尽职守、诚实后用、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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风

本基金基金合同生效日为2016年7月22日,基金业绩数据截至2020年6月30日。

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

2 2

0.91%

1.40%

1.30%

1.58%

0.98%

0.91%

1.30%

1.58%

基准收益 率③

-2.619

-0.13%

-31.85%

25.09%

10.84%

-5.80%

-0.13%

25.09%

10.84%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际

一三、基金的费用与税收

(11)按照国家有关规定和《基金台同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法

E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的

C类基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与

基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等,支付日

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.016%的

日 为每日计提的指数使用许可费 E 为前一日的基金资产净值 基金合同生效后的指数许可使用费按日计提,按季支付。根据基金管理人与标的指

数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民而10,000元,计费区间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金

管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划行指令,经基金托管人复修后于每年1月,4月,7月,10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基

金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数 据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

人 (A) 一致印刷分数据,目动作力形成。上上自己的规范目在的规定由任业门页重义门,建全管理人无害再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

-致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基

0.88%

1.43%

1.39%

1.70%

0.94%

0.88%

1.43%

1.70%

14. 及页组合报告附在时其他又于描述的扩 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差. 十二、基金的业绩

险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

6.79%

33.75%

17.789

-5.10%

7.64%

32.839

17.54%

(4)《基金合同》生效后与基金相关标的指数许可使用费; (5)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(6)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末,本基金未持有股指期货。 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

告编制目前一年内受到公开谴责,处罚的情形。 (2)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 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

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基金机构监管部部函[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

本基金管理人保证招募说明书的内容直实、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投资价值及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被动等因素产

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预期风险和高预期收益的品种。

本基金可投资补的极股票,为创放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,但于提销售服务费,A、C两类基金份额间取认申购费,B、C类基金份额 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,全面认识本基金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

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,由投资人自行负责。 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

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

金金上是八個所間內部,或然同用,重複數別是由於於可由是所是用金金別,同一作 金金一定為用,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

## 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

石術: 下並建立自共時級公司 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

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:中国证监会证监许可[2014]97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

联系人:张显

公司的股权结构如下:

) 主要人员情况

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、拉丁美洲股票期权之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、管理委员会成员。 黄劲峰先生,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、核算见习生、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、日本产品上发生7年12人次市时间 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、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协调、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营运官、亚太(除日本)首席营运官、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

持股比例

公成人。 徐恕成先生,董事,金融学硕士。历任中国国际金融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。现任中国国际金融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。历任中国国际金融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 赵璧先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理: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及银矿,同元至生,干信产业基金管理有限公司总资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。 汤琰女士,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总经理。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、东莞市星晨信息技术有限公司董事、三亚迈普乐科技有限公司董事,北京新媒传信科技有 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

至元先生,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准师。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。历任中国国际金融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。

白娜女士,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;中国国际金融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。

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。历任美国众达律师事务所北京代表处律师; 中国国际 金融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

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 理有限公司首席信息官、风险管理部负责人。

4、本基金基金经理 魏字先生,统计学博士。2010年8月至2014年10月,在北京尊嘉资产管理有限公司 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,现任量化公募投资部基金经理。

5、投资决策委员会成员 孙菁女士,管理学硕士。简历同上

赵璧先生,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:中国国际金融股份有 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经理。

日內以口,现比及氣管理節基並定理。 朱宝臣先生,理学硕士。历任中国国际金融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经理。 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

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55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35,640,625,7089万元

联系电话:010-66105799

一) 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. 直铛机构

名称:中金基金管理有限公司

任所: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:张显 客户服务电话:400-868-1166

(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 网址:http://www.china-invs.cn

电话:400-600-8008,95532 上海联泰基金销售有限公司

网址:http://www.66liantai.com/ 电话:400-118-1188 (3)平安证券股份有限公司

网址:www.stock.pingan.com 电话:95511-8 (4) 上海好买基金销售有限公司 电话:400-700-9665

(5)上海万得基金销售有限公司 网址:http://www.520fund.com.cn 电话:400-821-0203

6)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 网址::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- 53398816 (8)长城证券股份有限公司 网址:www.cgws.com 电话:95514

基金管理人:中金基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

(9)中国国际金融股份有限公司 网址:www.cicc.com 申话:010-65051166

10)中国银河证券股份有限公司 网址:www.chinastock.com.cn

(11)上海基煜基金销售有限公司 网站:www.jiyufund.com.cn 电话:400-820-5369

(12)和讯信息科技有限公司 网址:http://www.hexun.com/ 电话:400-159-9288 13)北京蛋卷基金销售有限公司

网址:danjuanapp.com 申话:400-159-9288 14)上海天天基金销售有限公司

网址:https://fund.eastmoney.com/ 15)上海挖财基金销售有限公司 网址:www.wacaijijin.com

电话:021-50810673 (16)通华财富(上海)基金销售有限公司 网站: https://www.tonghuafund.com 电话: 95156转5

(17)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司 网址:www.hongtaiwealth.com

电话:400-8189-598

(18)北京唐鼎耀华基金销售有限公司 网址:www.tdyhfund.com 申话:400-819-9868 19)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

网址:http://fund.jd.com (20)北京恒天明泽基金销售有限公司

网址:www.chtwm.com 电话:400-898-0618 (21)包商银行股份有限公司 www.bsb.com.cn

(22)北京植信基金销售有限公司 网址:www.zhixin-inv.com 客服由话·400-680-2123 23)南京苏宁基金销售有限公司

网站:www.snjijin.com (24)浙江同花顺基金销售有限公司 网址:www.5ifund.com

(25)济安财富(北京)基金销售有限公司 (26)中信建投证券股份有限公司

网址:www.csc108.com 电话: 400-888-8108 27)珠海盈米基金销售有限公司 网址:www.yingmi.cn 电话:020-89629099 (28)阳光人寿保险股份有限公司

网址:fund.sinosig.com (29)上海长量基金销售投资顾问有限公司

(30)东方财富证券股份有限公司 网址:http://www.xzsec.com 电话:95357 (31)招商银行股份有限公司 网址:http://www.cmbchina.com/

电话:95555 32)腾安基金销售(深圳)有限公司 网址:https://www.txfund.com/

(33)中信证券股份有限公司 网址:www.cs.ecitic.com 电话:95548

(34)中信证券(山东)有限责任公司 网址:http://sd.citics.com/ 电话:95548 (35)中信期货有限公司 网址:www.citicsf.com

电话:400-990-8826 36)中银国际证券股份有限公司 网址:www.bocichina.com 电话:400-620-8888 (37)万家财富基金销售(天津)有限公司

网址:http://www.wanjiawealth.com/ 电话:010-59013895 (38)上海证券有限责任公司 网址:https://www.shzq.com/ 电话:4008-918-918

(39)中信证券华南股份有限公司 网址: http://www.gzs.com.cn 电话:95396 40)北京汇成基金销售有限公司 网址:www.hciijin.com

电话:400-619-9059 (41)安信证券股份有限公司 网址:http://www.essence.com.cn

(42) 江苏汇林保大基金销售有限公司 网址:http://www.h 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 由迁,010\_62211122 传真:010-66155573

联系人:白娜 (三)出具法律意见书的律师事务所 名称:北京市海问律师事务所

住所:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层办公地址:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层

负责人:张继平 电话:(+86 10) 8560 6888 传真:(+86 10) 8560 6999 经办律师:魏双娟、高巍

联系人:魏双娟 (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8层 办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

执行事务合伙人:邹俊 电话:010-85087916 签章注册会计师:张君一、丁时杰

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。 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指数组合管理与风险控制,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%,年化跟踪误差不超过8.0%。 七、基金的投资方向

本基金投资范围主要为标的指数成分股及各选成分股。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(包含中小板、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、公司债、 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 加除股捐期货保证金以后,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。 八、基金的投资策略

本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,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。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、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。 本基金作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。本基金市/70米計區於自然自然是及過去組分核及金金,及宗政风采电/70米金金的於心來略。本基金股票投资主要策略为拆的指数投资策略,通过复制目标股票指数作为基本投资组合,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 标指数的相对收益. 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,并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

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 基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,产出投资组合,以追求超越标 的指数表现的业绩水平。 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, 利用历史数据回测和构

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 在重加以及模型。1,000円17年100年10日上午100个10日产生100年10日以及至日。1000亿亩的驱动因子可以和基本面投资相同或类似,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。

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5%,年代股龄误差不超过5%。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、印花税、佣金等

数据预测本基金的交易成本,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 基金将结合市场情况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

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和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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则以至期促值 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 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期 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

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A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 來歷並自年人於八,於近朝比较歷信日的能學必要及於本經並的风險收証付证。如 果指數編制單位停止计算編制该計劃數。或今后法律法規及生变化或更改指數支稅,或有 更适当的、更能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,而无需召开基金份额 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

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 基金官理人的重事云及重事深证本报宫中州载汉种个存任虚版记载、疾导任陈应或 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、误导性除述或者重大遗漏。 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	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	108,898,096.33	89.82
	其中:股票	108,898,096.33	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	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买 人返售金融资产	-	_
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	121,245,766.07	100.00

占基金资产净值比例(%) 公允价值(元) A 农、林、牧、渔业 1,085,140. B 采矿业 46.19 电力、热力、燃气及水生产和低 3.94 4,601,577.0 1,010,242.0 F 批发和零售 8,181,953.6 G 交通运输、仓储和邮政业 2,778,957.0 2.38 H 住宿和餐饮业 言息传输、软件和信息技术服务 8 462.941.1 7.25 J 金融业 5,779,843.4 4.95 K 房地产业 L 租赁和商务服务业 5,119,982.0 4.39 M 科学研究和技术服务|| N 水利、环境和公共设施管理业 453,600.0 0.39 区 居民服务、修理和其他服务业 Q 卫生和社会工作 1,253,000. R 文化、体育和娱乐》 2,117,821.0 1.82 754,608.0 (2)报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 占基金资产净值比例(%) 公允价值(元) 8,632,053.6 0.01 建筑业 F 批发和零售 538,118,0 0.46 交通运输、仓储和邮政业 H 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技术服务 1.266.448. 1.09

J 金融业 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 Q 卫生和社会工作 224,136.0 R 文化、体育和娱乐业 11,655,029

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

宏发股份

600885

018007

(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

股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 生物股份 600201 54.000 1,503,360,0 1,424,742.6 300088 1,420,160.0 603444 吉比特 1.395.034.43 603939 益丰药房 13,800 1.08 603882 金域医学 14.000 1.253.000.0 603233 大参林 14,980 1,216,675.6 1.04

601799 見字股份 1 206 500.0 (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

1,207,612.0

1,652,475.00

2,66

1.42

	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	20,900	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	<b>一</b> 债券品种		公允价值(元)		占	5基金资产净值比例(%)		
	1	国家债券		3,101,550.00 - 1,652,475.00			2.66 - 1.42		
	2	央行票据							
	3	金融债券							
		其中:政策性	金融债	1,652,475.00			1.42		

113	DG53-HH1-1-		A)UNIE()U/		[ [ ] [ ] [ ] [ ] [ ] [ ] [ ] [ ] [ ] [		
1	国家债券		3,101,550.00		2.66		
2	央行票据		-		-		
3	金融债券		1,652	2,475.00		1.42	
	其中:政策性金	融债	1,652	2,475.00		1.42	
4	企业债券		-		_		
5	6 中期票据		_			_	
6				-			
7			33	3,200.00		0.03	
8 同业存单			-		-		
9	其他		_		_		
10	合计		4,787	7,225.00		4.10	
5. 扌	设告期末按公	允价值占	基金资产净值	直比例大	小排序的前五名	债券投资明	
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公	允价值(元)	占基金资产 净值比例	

31,000

16,500

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

r, 4、在"第九部分基金的投资"中,更新了"基金投资组合报告"内容; 5、更新了"第十部分基金的业绩"; 6、在"第二十部分托管协议的内容摘要"中,更新了相关内容; 7、在"第二十二部分其他应拔露事项"中,披露了报告期内基金管理人在指定媒介上披露的与本基金相关的所有公告。

2020年8月8日

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书 及其更新中披露基金最新适用的方法。 上述"一、基金费用的种类中第5-11项费用",根据有关法规及相应协议规定,按 二)不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用: 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财

费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用; 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管 福川自生/2/位/// 1/14 / 1/1

更新的4券669行为近行了更新,并很贴本基金管理人对本基金实施的投资经营品的近行了 内容补充和更新,主要更新的内容如下: 1、在"重要提示"部分更新了相关内容; 2、在"第三部分基金管理人"中,对基金管理人的情况进行了更新; 3、在"第五部分相关服务机构"中,增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的