

中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	8
2.5	其他相关资料	8
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3	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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67

7.12	投资组合报告附注	67
§ 8	基金份额持有人信息	68
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 9	开放式基金份额变动	69
§ 10	重大事件揭示	69
10.1	基金份额持有人大会决议	69
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4	基金投资策略的改变	70
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	70
10.8	其他重大事件	71
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	72
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12	备查文件目录	72
12.1	备查文件目录	72
12.2	存放地点	72
12.3	查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信保诚中证 500 指数增强	
基金主代码	021185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 06 月 21 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	121,390,516.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	021185	021186
报告期末下属分级基金的份额总额	36,082,348.30 份	85,308,168.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅,在控制跟踪误差基础上,力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过前述范围的,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金,主要策略为复制标的指数,投资组合将以成份股在标的指数中的基准权重为基础,利用量化投资模型在一定范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。 基金管理人研发的量化投资模型借鉴国内外成熟的量化组合投资经验,运用多因子选股模型预测股票超额回报,在有效控制及交易成本的基础上,优化投资组合。 (1) 多因子选股模型 本基金采用量化方法,以对中国股票市场的长期研究为基础,构建多因子模型,从多个维度捕捉市场有效性暂时缺失之处,通过个股

	在多因子上的暴露估测个股的超值回报。概括来讲，本基金多因子模型的因子可归为价值、动量、成长、情绪、质量、事件等几类。上述因子类别综合了来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师及监管政策、公司事件等各方面信息。基金经理根据市场状况及变化，对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。 （2）风险估测模型 指数化投资力求跟踪误差最小，增强型投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险管理模型，力争将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。 （3）交易成本模型 本基金的交易成本模型既考虑固定交易成本，也考虑交易的市场冲击效应，在尽量降低总体交易成本的基础上，减少交易对业绩造成的负面影响。 （4）投资组合优化模型 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以标的指数成份股为主，并包括非成份股中与成份股相关性较强、流动性较好、基本面信息充足等特征的股票。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选相应的存托凭证投资标的。对于港股通标的股票，本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，精选出具有投资价值的优质标的。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。 2、债券投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行投资。 3、证券公司短期公司债券投资策略 本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。 4、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，研究资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收
--	---

	益结构安排，评估其内在价值。 5、可转换债券、可交换债券投资策略 本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，研究上市公司对转股价的修正和转股意愿。 6、衍生品投资策略 为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。 本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。 本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。 本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。 7、融资、转融通证券出借业务投资策略 本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。 利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。 为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
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	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		中信保诚基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	滕菲菲
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120895	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		涂一锴	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	3,097,694.27	11,931,570.62
本期利润	2,834,564.77	12,287,023.19
加权平均基金份额本期利润	0.0728	0.0994
本期加权平均净值利润率	4.24%	5.81%
本期基金份额净值增长率	8.91%	8.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	25,476,662.95	59,056,769.20
期末可供分配基金份额利润	0.7061	0.6923
期末基金资产净值	62,954,460.18	147,643,049.25
期末基金份额净值	1.7447	1.7307
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	74.47%	73.07%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

中信保诚中证 500 指数增强 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	7.66%	1.35%	17.61%	1.56%	-9.95%	-0.21%
过去六个月	8.91%	1.43%	19.93%	1.58%	-11.02%	-0.15%
过去一年	32.56%	1.23%	49.68%	1.35%	-17.12%	-0.12%
自基金合同生 效起至今	74.47%	1.36%	72.83%	1.50%	1.64%	-0.14%

中信保诚中证 500 指数增强 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	7.55%	1.35%	17.61%	1.56%	-10.06%	-0.21%
过去六个月	8.70%	1.43%	19.93%	1.58%	-11.23%	-0.15%
过去一年	32.03%	1.23%	49.68%	1.35%	-17.65%	-0.12%
自基金合同生 效起至今	73.07%	1.36%	72.83%	1.50%	0.24%	-0.14%

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

中信保诚中证 500 指数增强 A



中信保诚中证 500 指数增强 C



§ 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

本基金管理人于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中

信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，本基金管理人于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”更名为“中信保诚基金管理有限公司”。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中的基金为 95 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保

诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金、中信保诚先进制造混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚 90 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚周期优选混合型发起式证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中信保诚汇利债券型证券投资基金、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金、中信保诚消费机遇混合型发起式证券投资基金、中信保诚稳和利率债债券型证券投资基金、中信保诚医药精选混合型发起式证券投资基金、中信保诚科技智选混合型证券投资基金、中信保诚新能源主题混合型发起式证券投资基金、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金。

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		
王颖	量化投资部副总监 （主持工作）、基金经 理	2024 年 06 月 21 日	-	13	王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。现任量化投资部副总监（主持工作），中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚中证

					500 指数增强型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券，满足条件时自动执行交易系统中的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行检查和统计分析。本报告期，公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合之间未出现参与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% 的交易。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年，国内经济数据整体符合预期，在出口支撑下，生产端相对较强，但内需修复动能不足；二季度固定资产投资增速有所回落，社零消费数据低于预期。海外方面，受地缘冲突影响，全球通胀预期升温，全球资本市场风险偏好反复波动。

市场方面，上半年 A 股市场波动率有所提升，行情阶段性、结构性特征较为明显。1-2 月 A 股市场整体上涨，3 月受海外冲突影响，风险偏好下降，市场风险集中释放；二季度 A 股市场整体震荡上涨，但内部分化明显，结构性行情成为阶段主线。从行业表现上看，上半年，电子、通信行业领涨，行业指数涨幅突破 50%，建材、化工涨幅居前；消费服务、商贸零售、农林牧渔等行业跌幅居前。从量化角度看，上半年因子表现波动较大，轮动加剧：1-2 月，动量、成长、分析师预期类因子表现较强，估值类因子明显回撤；3 月，市场风险偏好下降，估值、盈利类因子表现突出，流动性、动量等因子回撤较大；二季度市场重回升势，成长、动量类因子表现持续突出，红利、价值、反转因子等因子超预期回撤。上半年，中证 500 内个股和因子表现分化较大，部分历史上长期有效的因子，如低波、低估值等均在二季度阶段性失效，因子收益显著回撤。

基金投资运作方面，本基金为指数增强型基金，跟踪的标的指数为中证 500 指数。一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

在投资策略方面，本基金以多因子量化投资策略为主，通过多策略分散投资，力求在控制基金与标的指数偏离度的基础上，获取更高的超额收益。本基金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，力争获得收益增厚。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为 8.91%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；中信保诚中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为 8.70%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

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 2026 年下半年，国内宏观经济有望延续弱复苏格局。A 股市场方面，在 7 月经历阶段性回调之后，结构性行情也已得到部分消化，市场核心逻辑或将由上半年的流动性驱动逐步转向盈利验证与基本面修复主导，下半年市场整体风险收益比有望改善。从量化角度看，若市场结构性行情有所缓解，因子表现也将有望得到修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。估值委员会由主管运营的公司领导、投资、研究、会计和风控等岗位资深人员组成。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程人员均具备相应的专业胜任能力及相关工作经历。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。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。在每个估值日，本基金管理人使用估值政策确定的估值方法，确定基金的份额净值，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法

法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司在中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	17,826,977.54	9,641,190.59
结算备付金		4,266,265.11	3,602,301.36
存出保证金		2,343,859.20	861,888.00
交易性金融资产	6.4.7.2	187,281,503.43	200,467,228.07
其中：股票投资		179,227,648.05	197,435,880.12
基金投资		—	—
债券投资		8,053,855.38	3,031,347.95
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		462,826.61	7,878,063.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		212,181,431.89	222,450,671.53
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,284,853.45	4,464,027.82
应付管理人报酬		145,820.05	157,179.22
应付托管费		18,227.49	19,647.37
应付销售服务费		51,565.06	61,022.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		261.74	18,511.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	83,194.67	144,000.00
负债合计		1,583,922.46	4,864,388.31
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	121,390,516.67	136,463,082.53
未分配利润	6.4.7.8	89,206,992.76	81,123,200.69
净资产合计		210,597,509.43	217,586,283.22
负债和净资产总计		212,181,431.89	222,450,671.53

注：截止本报告期末，基金份额总额 121,390,516.67 份。其中：中信保诚中证 500 指数增强 A 的基金份额净值 1.7447 元，基金份额总额 36,082,348.30 份；中信保诚中证 500 指数增强 C 的基金份额净值 1.7307 元，基金份额总额 85,308,168.37 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		16,896,632.04	12,802,366.12

1. 利息收入		37,435.21	41,809.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	37,435.21	38,870.67
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		-	2,938.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,618,220.98	4,746,547.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,924,974.81	2,745,522.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	41,759.40	15,194.66
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-716,124.96	388,609.86
股利收益	6.4.7.14	1,367,611.73	1,597,220.84
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	92,323.07	7,940,402.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	148,652.78	73,606.30
减：二、营业总支出		1,775,044.08	1,232,709.23
1. 管理人报酬		1,122,480.56	742,223.03
2. 托管费		140,310.07	92,777.89
3. 销售服务费		428,736.55	304,031.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,731.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,731.43	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,040.30	1,413.98
8. 其他费用	6.4.7.18	76,745.17	92,263.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,121,587.96	11,569,656.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,121,587.96	11,569,656.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,121,587.96	11,569,656.89

6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	136,463,082.53	81,123,200.69	217,586,283.22

二、本期期初净资产	136,463,082.53	81,123,200.69	217,586,283.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,072,565.86	8,083,792.07	-6,988,773.79
（一）、综合收益总额	-	15,121,587.96	15,121,587.96
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-15,072,565.86	-7,037,795.89	-22,110,361.75
其中：1. 基金申购款	471,981,052.69	350,493,507.37	822,474,560.06
2. 基金赎回款	-487,053,618.55	-357,531,303.26	-844,584,921.81
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	121,390,516.67	89,206,992.76	210,597,509.43
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	142,289,141.99	32,297,208.83	174,586,350.82
二、本期期初净资产	142,289,141.99	32,297,208.83	174,586,350.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,731,207.78	11,212,914.32	8,481,706.54
（一）、综合收益总额	-	11,569,656.89	11,569,656.89
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,731,207.78	-356,742.57	-3,087,950.35
其中：1. 基金申购款	330,429,402.60	85,962,022.75	416,391,425.35
2. 基金赎回款	-333,160,610.38	-86,318,765.32	-419,479,375.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	139,557,934.21	43,510,123.15	183,068,057.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星

基金管理人负责人

桂思毅

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚中证 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”)《关于准予中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]461 号)批准,由中信保诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2024 年

6 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 219,344,315.69 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金投资于股票、存托凭证的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业

协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信(2021)20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财

政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基

金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,886,498.52
等于：本金	1,886,269.74
加：应计利息	228.78
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	15,940,479.02
等于：本金	15,940,233.79
加：应计利息	245.23
合计	17,826,977.54

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		174,340,759.52	—	179,227,648.05	4,886,888.53
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	7,999,910.00	44,655.38	8,053,855.38	9,290.00
	银行间市场	—	—	—	—

	合计	7,999,910.00	44,655.38	8,053,855.38	9,290.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		182,340,669.52	44,655.38	187,281,503.43	4,896,178.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,415,081.91	-	-	-
IC2607	13,301,721.91	-	-	-
IC2608	3,464,960.00	-	-	-
IC2612	1,648,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,415,081.91	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	8.00	14,285,120.00	983,398.09
IC2608	IC2608	2.00	3,538,560.00	73,600.00
IC2612	IC2612	1.00	1,708,480.00	60,080.00
合计				1,117,078.09
减：可抵销期货暂收款				1,117,078.09
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	11,900.75
应付信息披露费	59,507.37
其他	11,786.55
合计	83,194.67

6.4.7.7 实收基金

中信保诚中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,913,115.92	31,913,115.92
本期申购	53,403,696.89	53,403,696.89
本期赎回（以“-”号填列）	-49,234,464.51	-49,234,464.51
本期末	36,082,348.30	36,082,348.30

中信保诚中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,549,966.61	104,549,966.61
本期申购	418,577,355.80	418,577,355.80
本期赎回（以“-”号填列）	-437,819,154.04	-437,819,154.04
本期末	85,308,168.37	85,308,168.37

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

中信保诚中证 500 指数增强 A

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
上年度末	18,240,832.00	968,974.29	19,209,806.29
本期期初	18,240,832.00	968,974.29	19,209,806.29
本期利润	3,097,694.27	-263,129.50	2,834,564.77
本期基金份额交易产生的变动数	4,138,136.68	689,604.14	4,827,740.82
其中：基金申购款	39,149,418.09	1,936,580.37	41,085,998.46
基金赎回款	-35,011,281.41	-1,246,976.23	-36,258,257.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,476,662.95	1,395,448.93	26,872,111.88

中信保诚中证 500 指数增强 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
上年度末	58,753,356.43	3,160,037.97	61,913,394.40
本期期初	58,753,356.43	3,160,037.97	61,913,394.40
本期利润	11,931,570.62	355,452.57	12,287,023.19
本期基金份额交易产生的变动数	-11,628,157.85	-237,378.86	-11,865,536.71
其中：基金申购款	296,663,092.49	12,744,416.42	309,407,508.91
基金赎回款	-308,291,250.34	-12,981,795.28	-321,273,045.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,056,769.20	3,278,111.68	62,334,880.88

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	11,869.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,833.69
结算备付金利息收入	20,732.13
其他	-
合计	37,435.21

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,900,371,646.29
减：卖出股票成本总额	1,882,497,812.10
减：交易费用	1,948,859.38
买卖股票差价收入	15,924,974.81

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	46,104.40
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-4,345.00
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	41,759.40

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,119,486.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,003,785.00
减：应计利息总额	120,046.86
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-4,345.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益—其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-716,124.96

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,367,611.73
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	1,367,611.73

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-718,507.30
--股票投资	-726,872.30
--债券投资	8,365.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	800,503.27
--权证投资	-
--期货投资	800,503.27
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-10,327.10
合计	92,323.07

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	148,556.27
转换费收入	96.51
合计	148,652.78

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	0.84
银行费用	5,336.21
合计	76,745.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,122,480.56	742,223.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	539,899.36	360,765.94
应支付基金管理人的净管理费	582,581.20	381,457.09

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 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×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	140,310.07	92,777.89

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金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。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
----------------	--

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	27,741.18	27,741.18
合计	-	27,741.18	27,741.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	51,077.95	51,077.95
合计	-	51,077.95	51,077.95

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40% 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：

$C \text{ 类基金份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	1,886,498.52	11,869.39	1,058,169.73	12,346.10

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2026 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	锁定期股票	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	53.26	58.74	137	7,296.62	8,047.38	-
00124	华润	2026 年	1 个月	新股未	10.11	10.11	3,515	35,536.65	35,536.65	-

8	新能	06 月 24 日	内 (含)	上市						
001248	华润新能	2026 年 06 月 24 日	6 个月	锁定期 股票	10.11	10.11	8,203	82,932.33	82,932.33	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期 股票	7.82	20.74	1,565	12,238.30	32,458.10	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	锁定期 股票	18.38	16.78	133	2,444.54	2,231.74	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	锁定期 股票	27.19	31.31	360	9,788.40	11,271.60	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	锁定期 股票	30.38	38.99	253	7,686.14	9,864.47	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期 股票	10.12	27.73	1,278	12,933.36	35,438.94	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	锁定期 股票	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	锁定期 股票	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	锁定期 股票	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	锁定期 股票	46.08	463.33	549	25,297.92	254,368.17	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	锁定期 股票	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	锁定期 股票	58.00	112.16	91	5,278.00	10,206.56	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期 股票	69.66	160.06	318	22,151.88	50,899.08	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期 股票	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

		日								
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	202	2,258.36	3,553.18	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	锁定期股票	33.49	33.93	66	2,210.34	2,239.38	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	锁定期股票	21.88	25.52	78	1,706.64	1,990.56	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	锁定期股票	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	15.76	46.71	90	1,418.40	4,203.90	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	17.70	84.32	243	4,301.10	20,489.76	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	126	5,163.48	38,831.94	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	950	16,644.00	34,124.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	锁定期股票	29.06	48.56	4,487	130,392.22	217,888.72	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	锁定期股票	22.68	42.16	3,258	73,891.44	137,357.28	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	锁定期股票	92.18	463.15	54	4,977.72	25,010.10	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 09 日	9 个月	锁定期股票	83.06	126.45	725	60,218.50	91,676.25	-

688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	锁定期股票	114.28	676.94	886	101,252.08	599,768.84	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	44.56	468.67	95	4,233.20	44,523.65	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	9 个月	锁定期股票	104.66	768.89	666	69,703.56	512,080.74	-
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	锁定期股票	81.88	1,584.33	91	7,451.08	144,174.03	-
688811	有研新材	2026 年 04 月 01 日	6 个月	锁定期股票	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	锁定期股票	55.95	57.10	99	5,539.05	5,652.90	-
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	9.47	70.14	715	6,771.05	50,150.10	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	锁定期股票	19.68	141.49	530	10,430.40	74,989.70	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 06 月 24 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.04	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等。董事会下设审计委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息，或基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用

评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。本基金的活期银行存款通过本基金的托管人存放在银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构的证券账户内，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,051,855.34	3,031,347.95
合计	8,051,855.34	3,031,347.95

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,000.04	-
未评级	-	-
合计	2,000.04	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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, 另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。

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。

针对资产变现流动性风险, 本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额, 并及时追踪持仓证券的流动性情况, 综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《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》等法规的要求建立了流动性风险管理的内部控制体系, 审慎评估各类资产的流动性, 并通过对基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值等指标进行监控, 以及定期开展压力测试等方式防范流动性风险。

本基金投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具, 所持大部分证券在证券交易所或者银行间同业市场交易, 除在期末本基金持有的流通受限证券章节部分所列示券种暂时受限制不能自由转让以外, 其余均能及时变现。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。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或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(净资产)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动, 使基金资产面临损失的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	17,826,977.54	-	-	-	-	-	17,826,977.54
结算备付金	4,266,265.11	-	-	-	-	-	4,266,265.11
存出保证金	-	-	-	-	-	2,343,859.20	2,343,859.20
交易性金融资产	-	-	8,051,855.34	-	2,000.04	179,227,648.05	187,281,503.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	462,826.61	462,826.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,093,242.65	-	8,051,855.34	-	2,000.04	182,034,333.86	212,181,431.89
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,284,853.45	1,284,853.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	145,820.05	145,820.05
应付托管费	-	-	-	-	-	18,227.49	18,227.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,565.06	51,565.06

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	261.74	261.74
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	83,194.67	83,194.67
负债总计	-	-	-	-	-	1,583,922.46	1,583,922.46
利率敏感度缺口	22,093,242.65	-	8,051,855.34	-	2,000.04	180,450,411.40	210,597,509.43
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	9,641,190.59	-	-	-	-	-	9,641,190.59
结算备付金	3,602,301.36	-	-	-	-	-	3,602,301.36
存出保证金	-	-	-	-	-	861,888.00	861,888.00
交易性金融资产	1,011,155.07	-	2,020,192.88	-	-	197,435,880.12	200,467,228.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	7,878,063.51	7,878,063.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,254,647.02	-	2,020,192.88	-	-	206,175,831.63	222,450,671.53
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,464,027.82	4,464,027.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	157,179.22	157,179.22
应付托管费	-	-	-	-	-	19,647.37	19,647.37
应付销售服务	-	-	-	-	-	61,022.04	61,022.04

费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	18,511.86	18,511.86
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	144,000.00	144,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,864,388.31	4,864,388.31
利率敏感度缺口	14,254,647.02	-	2,020,192.88	-	-	201,311,443.32	217,586,283.22

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变 2、该利率敏感性分析不包括可转换债券和可交换债券		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2026年06月30日)	上年度末(2025年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	10,927.07	1,552.41
	市场利率上升 25 个基点	-10,897.49	-1,550.32

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，并运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	179,227,648.05	85.10	197,435,880.12	90.74
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,000.04	0.00	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	179,229,648.09	85.10	197,435,880.12	90.74

注：本表中交易性金融资产—债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2026 年 06 月 30 日)	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	8,760,819.03	9,169,318.59
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-8,760,819.03	-9,169,318.59

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	176,526,576.33	195,806,240.16
第二层次	8,172,324.36	3,031,347.95

第三层次	2,582,602.74	1,629,639.96
合计	187,281,503.43	200,467,228.07

6.4.14.2.2 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	179,227,648.05	84.47
	其中：股票	179,227,648.05	84.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,053,855.38	3.80
	其中：债券	8,053,855.38	3.80
	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	22,093,242.65	10.41
8	其他各项资产	2,806,685.81	1.32
9	合计	212,181,431.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	415,575.00	0.20
B	采矿业	3,517,864.00	1.67
C	制造业	121,250,774.52	57.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,073,858.00	1.93
E	建筑业	845,940.00	0.40
F	批发和零售业	1,891,476.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,786,710.00	0.85
H	住宿和餐饮业	30,583.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,152,601.71	7.20
J	金融业	9,447,247.80	4.49
K	房地产业	882,247.00	0.42
L	租赁和商务服务业	868,246.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	1,047,269.12	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	1,156,946.48	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	100,010.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,267,290.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	163,734,638.63	77.75

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	520,186.10	0.25
C	制造业	11,933,781.60	5.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	118,468.98	0.06
E	建筑业	565,110.00	0.27
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,805,749.30	0.86
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	2,443.98	0.00

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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	545,686.00	0.26
	合计	15,493,009.42	7.36

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688002	睿创微纳	31,459	4,866,392.71	2.31
2	001309	德明利	4,400	4,148,760.00	1.97
3	601869	长飞光纤	7,000	3,821,300.00	1.81
4	688728	格科微	180,718	3,802,306.72	1.81
5	688099	晶晨股份	36,656	3,771,902.40	1.79
6	688347	华虹宏力	8,713	2,930,181.90	1.39
7	301536	星宸科技	21,500	2,767,265.00	1.31
8	600171	上海贝岭	84,900	2,711,706.00	1.29
9	301358	湖南裕能	34,000	2,579,580.00	1.22
10	002008	大族激光	16,900	2,536,859.00	1.20
11	002812	恩捷股份	37,500	2,509,125.00	1.19
12	002064	华峰化学	246,800	2,342,132.00	1.11
13	600392	盛和资源	76,500	2,277,405.00	1.08
14	601179	中国西电	142,500	2,126,100.00	1.01
15	002414	高德红外	159,300	2,112,318.00	1.00
16	600595	中孚实业	332,100	1,866,402.00	0.89
17	002756	永兴材料	32,100	1,818,144.00	0.86
18	301606	绿联科技	28,400	1,732,968.00	0.82
19	300073	当升科技	33,900	1,628,556.00	0.77
20	000738	航发控制	83,000	1,518,070.00	0.72
21	603077	和邦生物	653,300	1,515,656.00	0.72
22	000683	博源化工	259,700	1,495,872.00	0.71
23	600685	中船防务	57,015	1,450,461.60	0.69
24	002185	华天科技	64,000	1,427,840.00	0.68
25	688578	艾力斯	12,975	1,416,870.00	0.67

26	688702	盛科通信	3,597	1,402,794.03	0.67
27	601128	常熟银行	235,840	1,372,588.80	0.65
28	300454	深信服	14,000	1,346,800.00	0.64
29	688411	海博思创	4,599	1,339,228.80	0.64
30	002430	杭氧股份	41,000	1,269,360.00	0.60
31	300432	富临精工	62,100	1,247,589.00	0.59
32	300496	中科创达	20,100	1,241,979.00	0.59
33	688278	特宝生物	22,806	1,240,646.40	0.59
34	603699	纽威股份	23,000	1,156,900.00	0.55
35	000800	一汽解放	191,400	1,138,830.00	0.54
36	688266	泽璟制药	9,727	1,134,751.82	0.54
37	603379	三美股份	14,600	1,107,994.00	0.53
38	688692	达梦数据	4,443	1,085,380.47	0.52
39	601799	星宇股份	11,900	1,078,378.00	0.51
40	600885	宏发股份	31,100	1,072,639.00	0.51
41	600332	白云山	53,300	1,068,132.00	0.51
42	601699	潞安环能	74,000	1,056,720.00	0.50
43	600141	兴发集团	22,000	1,033,340.00	0.49
44	688615	合合信息	8,844	1,000,256.40	0.47
45	000831	中国稀土	18,000	998,820.00	0.47
46	603486	科沃斯	19,600	994,700.00	0.47
47	600499	科达制造	70,500	972,900.00	0.46
48	688281	华秦科技	19,327	970,795.21	0.46
49	000783	长江证券	99,200	967,200.00	0.46
50	002410	广联达	114,200	931,872.00	0.44
51	603650	彤程新材	9,500	930,810.00	0.44
52	000027	深圳能源	149,900	929,380.00	0.44
53	002603	以岭药业	61,400	921,000.00	0.44
54	300953	震裕科技	6,800	909,160.00	0.43
55	000883	湖北能源	209,300	904,176.00	0.43
56	603156	养元饮品	18,400	902,888.00	0.43
57	600535	天士力	67,400	891,702.00	0.42
58	601233	桐昆股份	40,800	883,320.00	0.42
59	601106	中国一重	267,500	882,750.00	0.42
60	000703	恒逸石化	64,700	877,979.00	0.42
61	688629	华丰科技	4,599	862,358.49	0.41
62	601555	东吴证券	107,600	852,192.00	0.40
63	002153	石基信息	117,800	851,694.00	0.40
64	601108	财通证券	98,320	850,468.00	0.40
65	002517	恺英网络	52,200	848,250.00	0.40
66	002487	大金重工	14,500	840,565.00	0.40

67	600380	健康元	89,100	839,322.00	0.40
68	002025	航天电器	11,000	838,420.00	0.40
69	603233	大参林	54,800	823,644.00	0.39
70	688498	源杰科技	432	814,752.00	0.39
71	603606	东方电缆	19,560	811,935.60	0.39
72	600582	天地科技	178,600	794,770.00	0.38
73	603858	步长制药	53,800	785,480.00	0.37
74	300676	华大基因	22,000	771,320.00	0.37
75	603816	顾家家居	34,400	769,184.00	0.37
76	603444	吉比特	2,100	752,682.00	0.36
77	600109	国金证券	85,500	750,690.00	0.36
78	601155	新城控股	72,700	745,902.00	0.35
79	600546	山煤国际	67,600	738,868.00	0.35
80	600884	杉杉股份	52,300	708,665.00	0.34
81	002056	横店东磁	22,700	691,896.00	0.33
82	600517	国网英大	145,700	681,876.00	0.32
83	601139	深圳燃气	119,400	675,804.00	0.32
84	002266	浙富控股	132,500	670,450.00	0.32
85	600369	西南证券	166,200	668,124.00	0.32
86	600312	平高电气	37,600	664,016.00	0.32
87	001286	陕西能源	63,300	641,862.00	0.30
88	600170	上海建工	288,400	640,248.00	0.30
89	688349	三一重能	41,289	626,767.02	0.30
90	601958	金钼股份	22,100	621,231.00	0.29
91	000623	吉林敖东	34,200	606,366.00	0.29
92	601098	中南传媒	60,600	596,304.00	0.28
93	002926	华西证券	72,600	593,142.00	0.28
94	300604	长川科技	1,700	580,414.00	0.28
95	000729	燕京啤酒	56,400	571,332.00	0.27
96	600390	五矿资本	124,700	568,632.00	0.27
97	000629	钒钛股份	155,000	517,700.00	0.25
98	600927	永安期货	41,400	515,430.00	0.24
99	601019	山东出版	80,400	514,560.00	0.24
100	600688	上海石化	173,500	508,355.00	0.24
101	601000	唐山港	118,200	490,530.00	0.23
102	601880	辽港股份	354,700	489,486.00	0.23
103	600060	海信视像	17,400	484,938.00	0.23
104	600153	建发股份	61,000	483,730.00	0.23
105	688120	华海清科	1,492	480,692.56	0.23
106	600177	雅戈尔	63,700	479,661.00	0.23
107	002281	光迅科技	1,800	462,492.00	0.22

108	300857	协创数据	1,300	441,870.00	0.21
109	300136	信维通信	3,700	441,225.00	0.21
110	300140	节能环保	84,100	417,977.00	0.20
111	300972	万辰集团	2,400	416,184.00	0.20
112	002032	苏泊尔	10,400	411,840.00	0.20
113	002120	韵达股份	64,500	410,220.00	0.19
114	600295	鄂尔多斯	37,400	400,928.00	0.19
115	000709	河钢股份	205,500	398,670.00	0.19
116	300223	君正股份	1,500	373,350.00	0.18
117	688361	中科飞测	863	371,090.00	0.18
118	600655	豫园股份	82,700	339,897.00	0.16
119	600808	马钢股份	135,700	339,250.00	0.16
120	002436	兴森科技	6,400	326,080.00	0.15
121	688200	华峰测控	609	319,785.90	0.15
122	300285	国瓷材料	3,000	309,540.00	0.15
123	002299	圣农发展	20,300	307,748.00	0.15
124	300054	鼎龙股份	2,900	307,313.00	0.15
125	688037	芯源微	699	306,895.95	0.15
126	600598	北大荒	28,200	305,688.00	0.15
127	600105	永鼎股份	4,400	296,912.00	0.14
128	300666	江丰电子	800	294,880.00	0.14
129	688777	中控技术	2,386	280,355.00	0.13
130	000021	深科技	4,200	269,934.00	0.13
131	002851	麦格米特	1,600	267,488.00	0.13
132	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.12
133	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.12
134	300346	南大光电	2,600	240,890.00	0.11
135	002407	多氟多	4,500	226,035.00	0.11
136	002409	雅克科技	1,000	224,500.00	0.11
137	300567	精测电子	700	222,320.00	0.11
138	600498	烽火通信	3,000	220,800.00	0.10
139	002138	顺络电子	3,000	219,300.00	0.10
140	688313	仕佳光子	1,172	216,409.80	0.10
141	300395	菲利华	1,600	213,968.00	0.10
142	600879	航天电子	9,900	210,771.00	0.10
143	300390	天华新能	2,200	205,722.00	0.10
144	688469	芯联集成	18,962	201,186.82	0.10
145	301526	国际复材	4,300	200,681.00	0.10
146	688019	安集科技	589	199,941.94	0.09
147	688017	绿的谐波	462	193,051.32	0.09
148	300620	光库科技	500	189,100.00	0.09

149	300373	扬杰科技	1,200	188,676.00	0.09
150	300058	蓝色光标	13,600	187,136.00	0.09
151	603256	宏和科技	700	185,731.00	0.09
152	300037	新宙邦	2,000	185,700.00	0.09
153	002273	水晶光电	5,200	184,496.00	0.09
154	688172	燕东微	2,153	180,119.98	0.09
155	605358	立昂微	2,300	178,480.00	0.08
156	300751	迈为股份	600	169,476.00	0.08
157	600988	赤峰黄金	6,300	165,816.00	0.08
158	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.08
159	002126	银轮股份	3,200	159,360.00	0.08
160	002738	中矿资源	2,700	159,273.00	0.08
161	605589	圣泉集团	2,500	158,925.00	0.08
162	000960	锡业股份	3,700	157,953.00	0.08
163	600601	方正科技	11,300	156,392.00	0.07
164	300570	太辰光	600	148,026.00	0.07
165	688052	纳芯微	494	142,425.14	0.07
166	001389	广合科技	600	142,350.00	0.07
167	002195	岩山科技	21,400	139,956.00	0.07
168	600497	驰宏锌锗	11,400	138,054.00	0.07
169	688027	国盾量子	268	135,074.68	0.06
170	002261	拓维信息	4,800	134,448.00	0.06
171	002850	科达利	700	132,510.00	0.06
172	600157	永泰能源	82,300	132,503.00	0.06
173	002821	凯莱英	800	129,600.00	0.06
174	600711	盛屯矿业	11,700	128,349.00	0.06
175	688235	百济神州	499	127,050.39	0.06
176	002340	格林美	19,200	126,912.00	0.06
177	688234	天岳先进	731	126,835.81	0.06
178	600909	华安证券	11,400	126,654.00	0.06
179	003031	中瓷电子	700	126,210.00	0.06
180	301611	珂玛科技	700	126,049.00	0.06
181	600143	金发科技	8,100	125,145.00	0.06
182	300017	网宿科技	9,400	122,294.00	0.06
183	002131	利欧股份	25,600	121,600.00	0.06
184	002203	海亮股份	5,200	118,820.00	0.06
185	600352	浙江龙盛	9,800	118,678.00	0.06
186	002966	苏州银行	16,900	117,624.00	0.06
187	603659	璞泰来	4,000	115,720.00	0.05
188	300339	润和软件	3,000	115,530.00	0.05
189	300759	康龙化成	3,900	112,827.00	0.05

190	688220	翱捷科技	888	110,396.16	0.05
191	688213	思特威	1,021	109,318.47	0.05
192	603308	应流股份	1,800	108,720.00	0.05
193	301200	大族数控	300	108,195.00	0.05
194	300207	欣旺达	5,600	106,344.00	0.05
195	300001	特锐德	2,800	105,924.00	0.05
196	002601	龙佰集团	6,300	103,824.00	0.05
197	002797	第一创业	15,800	103,806.00	0.05
198	002472	双环传动	2,500	103,775.00	0.05
199	300458	全志科技	2,600	102,596.00	0.05
200	603129	春风动力	400	102,320.00	0.05
201	688387	信科移动	5,156	102,295.04	0.05
202	688385	复旦微电	1,424	101,516.96	0.05
203	300115	长盈精密	3,600	100,584.00	0.05
204	601198	东兴证券	7,300	99,207.00	0.05
205	601991	大唐发电	14,000	99,120.00	0.05
206	002155	湖南黄金	4,100	97,867.00	0.05
207	002465	海格通信	7,500	95,775.00	0.05
208	600563	法拉电子	500	95,400.00	0.05
209	603179	新泉股份	1,900	94,335.00	0.04
210	601665	齐鲁银行	16,300	94,051.00	0.04
211	002130	沃尔核材	4,800	91,008.00	0.04
212	300024	机器人	4,700	90,851.00	0.04
213	002402	和而泰	3,500	90,405.00	0.04
214	601162	天风证券	26,600	89,642.00	0.04
215	000060	中金岭南	11,700	88,569.00	0.04
216	002429	兆驰股份	8,500	88,315.00	0.04
217	688322	奥比中光	670	87,468.50	0.04
218	000878	云南铜业	5,500	87,340.00	0.04
219	300012	华测检测	6,300	87,318.00	0.04
220	601099	太平洋	25,700	86,609.00	0.04
221	688301	奕瑞科技	698	86,552.00	0.04
222	000893	亚钾国际	2,100	85,869.00	0.04
223	688608	恒玄科技	512	85,601.28	0.04
224	300623	捷捷微电	1,900	85,481.00	0.04
225	002271	东方雨虹	7,200	85,464.00	0.04
226	000733	振华科技	1,500	84,960.00	0.04
227	002335	科华数据	2,000	84,900.00	0.04
228	002432	九安医疗	1,200	84,816.00	0.04
229	300474	景嘉微	1,400	84,672.00	0.04
230	688676	金盘科技	996	84,301.44	0.04

231	002444	巨星科技	2,700	83,970.00	0.04
232	689009	九号公司	2,200	83,930.00	0.04
233	600256	广汇能源	16,900	83,486.00	0.04
234	600298	安琪酵母	2,300	83,260.00	0.04
235	000034	神州数码	3,000	83,250.00	0.04
236	603979	金诚信	1,400	82,642.00	0.04
237	603688	石英股份	1,000	82,610.00	0.04
238	603920	世运电路	1,700	81,668.00	0.04
239	300763	锦浪科技	900	81,315.00	0.04
240	300748	金力永磁	2,600	80,210.00	0.04
241	600699	均胜电子	3,700	79,957.00	0.04
242	000661	长春高新	1,200	79,920.00	0.04
243	600021	上海电力	5,300	79,871.00	0.04
244	601696	中银证券	6,300	79,695.00	0.04
245	603087	甘李药业	1,400	79,464.00	0.04
246	601577	长沙银行	9,100	79,261.00	0.04
247	002078	太阳纸业	6,300	78,687.00	0.04
248	601615	明阳智能	6,800	78,676.00	0.04
249	002157	正邦科技	27,900	78,399.00	0.04
250	688018	乐鑫科技	610	78,031.20	0.04
251	300142	沃森生物	6,000	77,940.00	0.04
252	000423	东阿阿胶	1,700	77,112.00	0.04
253	002252	上海莱士	17,400	75,516.00	0.04
254	688188	柏楚电子	703	75,010.10	0.04
255	688599	天合光能	5,299	74,821.88	0.04
256	688331	荣昌生物	571	74,378.46	0.04
257	300919	中伟新材	1,700	74,375.00	0.04
258	000728	国元证券	9,900	74,151.00	0.04
259	688343	云天励飞	891	72,759.06	0.03
260	300724	捷佳伟创	1,000	70,600.00	0.03
261	001203	大中矿业	2,300	68,885.00	0.03
262	000786	北新建材	3,800	68,742.00	0.03
263	688180	君实生物	2,023	68,417.86	0.03
264	002831	裕同科技	1,900	67,564.00	0.03
265	300383	光环新网	5,400	67,176.00	0.03
266	688617	惠泰医疗	368	66,814.08	0.03
267	300677	英科医疗	1,700	66,589.00	0.03
268	688169	石头科技	699	66,384.03	0.03
269	603119	浙江荣泰	1,000	66,340.00	0.03
270	300679	电连技术	1,100	65,989.00	0.03
271	002673	西部证券	10,100	65,549.00	0.03

272	603806	福斯特	3,900	65,481.00	0.03
273	600516	方大炭素	10,600	65,402.00	0.03
274	000519	中兵红箭	3,100	65,317.00	0.03
275	688065	凯赛生物	1,360	65,076.00	0.03
276	300558	贝达药业	1,000	65,070.00	0.03
277	000559	万向钱潮	5,000	64,650.00	0.03
278	600642	申能股份	7,400	64,602.00	0.03
279	603345	安井食品	800	64,152.00	0.03
280	688187	时代电气	930	63,853.80	0.03
281	002624	完美世界	5,100	63,342.00	0.03
282	688568	中科星图	1,524	63,200.28	0.03
283	600637	东方明珠	7,600	63,156.00	0.03
284	300699	光威复材	2,200	63,030.00	0.03
285	001696	宗申动力	3,000	62,430.00	0.03
286	000750	国海证券	16,900	62,192.00	0.03
287	002318	久立特材	2,600	62,140.00	0.03
288	002085	万丰奥威	5,600	62,104.00	0.03
289	000983	山西焦煤	10,700	62,060.00	0.03
290	603160	汇顶科技	1,000	61,710.00	0.03
291	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.03
292	603225	新凤鸣	3,100	60,915.00	0.03
293	002739	儒意电影	6,300	60,480.00	0.03
294	002065	东华软件	8,400	59,976.00	0.03
295	688375	国博电子	575	59,972.50	0.03
296	300627	华测导航	2,100	59,640.00	0.03
297	002044	美年健康	11,800	59,354.00	0.03
298	600536	中国软件	2,100	59,052.00	0.03
299	002223	鱼跃医疗	2,300	59,018.00	0.03
300	300487	蓝晓科技	1,000	58,850.00	0.03
301	000155	川能动力	4,900	58,702.00	0.03
302	688772	珠海冠宇	2,988	58,654.44	0.03
303	000400	许继电气	2,700	58,590.00	0.03
304	300003	乐普医疗	4,900	58,065.00	0.03
305	300002	神州泰岳	7,400	57,794.00	0.03
306	600985	淮北矿业	4,100	57,605.00	0.03
307	601016	节能风电	14,800	57,424.00	0.03
308	000032	深桑达 A	2,300	57,385.00	0.03
309	603596	伯特利	2,300	57,132.00	0.03
310	601717	中创智领	4,100	57,031.00	0.03
311	000415	渤海租赁	14,000	56,980.00	0.03
312	000039	中集集团	7,000	56,770.00	0.03

313	601216	君正集团	12,700	56,642.00	0.03
314	601997	贵阳银行	11,000	56,430.00	0.03
315	600521	华海药业	3,900	56,160.00	0.03
316	600862	中航高科	3,100	55,893.00	0.03
317	600863	华能蒙电	11,800	55,460.00	0.03
318	002841	视源股份	1,600	55,248.00	0.03
319	600704	物产中大	11,700	55,224.00	0.03
320	603766	隆鑫通用	4,600	54,878.00	0.03
321	601990	南京证券	8,300	54,531.00	0.03
322	600873	梅花生物	7,400	54,390.00	0.03
323	688538	和辉光电	20,824	54,142.40	0.03
324	603605	珀莱雅	900	53,928.00	0.03
325	601001	晋控煤业	3,100	53,909.00	0.03
326	000887	中鼎股份	3,000	53,670.00	0.03
327	600765	中航重机	4,100	52,972.00	0.03
328	000967	盈峰环境	5,000	52,650.00	0.03
329	688297	中无人机	1,263	52,477.65	0.02
330	600166	福田汽车	17,900	52,089.00	0.02
331	600348	华阳股份	6,800	52,020.00	0.02
332	000830	鲁西化工	4,300	51,600.00	0.02
333	000062	深圳华强	1,600	50,912.00	0.02
334	002939	长城证券	6,100	50,874.00	0.02
335	688248	南网科技	734	50,778.12	0.02
336	600486	扬农化工	1,000	50,700.00	0.02
337	601611	中国核建	4,500	50,175.00	0.02
338	600363	联创光电	1,400	50,092.00	0.02
339	600901	江苏金租	8,700	50,025.00	0.02
340	002007	华兰生物	4,100	49,979.00	0.02
341	002683	广东宏大	1,700	49,793.00	0.02
342	600737	中粮糖业	4,000	49,320.00	0.02
343	600578	京能电力	7,600	49,020.00	0.02
344	603728	鸣志电器	800	48,736.00	0.02
345	603298	杭叉集团	2,000	47,720.00	0.02
346	000737	北方铜业	3,600	47,592.00	0.02
347	600316	洪都航空	1,700	47,498.00	0.02
348	000591	太阳能	10,300	47,380.00	0.02
349	600398	海澜之家	9,000	47,070.00	0.02
350	603568	伟明环保	3,046	46,847.48	0.02
351	000528	柳 工	6,200	46,810.00	0.02
352	000921	海信家电	1,700	46,444.00	0.02
353	600995	南网储能	3,700	45,510.00	0.02

354	600208	衢州发展	16,000	45,280.00	0.02
355	600008	首创环保	16,600	45,152.00	0.02
356	000932	华菱钢铁	13,000	45,110.00	0.02
357	688114	华大智造	883	45,103.64	0.02
358	600435	北方导航	4,000	44,800.00	0.02
359	000987	越秀资本	5,700	44,574.00	0.02
360	600998	九州通	9,500	44,555.00	0.02
361	688318	财富趋势	622	44,354.82	0.02
362	002152	广电运通	4,700	44,086.00	0.02
363	000997	新大陆	2,700	44,010.00	0.02
364	688582	芯动联科	671	43,615.00	0.02
365	600820	隧道股份	8,300	43,243.00	0.02
366	002262	恩华药业	2,300	43,125.00	0.02
367	000951	中国重汽	2,200	42,922.00	0.02
368	600161	天坛生物	3,700	42,846.00	0.02
369	600483	福能股份	4,200	42,798.00	0.02
370	603338	浙江鼎力	1,000	42,500.00	0.02
371	603341	龙旗科技	1,000	42,490.00	0.02
372	000009	中国宝安	6,800	42,364.00	0.02
373	603885	吉祥航空	4,100	42,189.00	0.02
374	002500	山西证券	8,100	41,796.00	0.02
375	600583	海油工程	8,300	41,749.00	0.02
376	603939	益丰药房	2,300	41,354.00	0.02
377	000582	北部湾港	3,800	40,774.00	0.02
378	600763	通策医疗	1,200	40,656.00	0.02
379	600038	中直股份	1,600	40,464.00	0.02
380	600562	国睿科技	1,900	40,318.00	0.02
381	601666	平煤股份	5,600	40,040.00	0.02
382	002312	川发龙蟒	4,300	39,431.00	0.02
383	688166	博瑞医药	1,123	39,316.23	0.02
384	603565	中谷物流	4,000	39,240.00	0.02
385	000723	美锦能源	11,700	39,195.00	0.02
386	003022	联泓新科	1,500	38,850.00	0.02
387	601567	三星电气	2,600	38,844.00	0.02
388	601156	东航物流	2,400	38,688.00	0.02
389	600602	云赛智联	2,400	38,592.00	0.02
390	601399	国机重装	10,900	38,150.00	0.02
391	601865	福莱特	3,600	37,836.00	0.02
392	000513	丽珠集团	1,300	37,557.00	0.02
393	600329	达仁堂	1,000	37,220.00	0.02
394	600132	重庆啤酒	900	37,170.00	0.02

395	688778	厦钨新能	675	36,720.00	0.02
396	000739	普洛药业	2,200	36,652.00	0.02
397	000598	兴蓉环境	5,700	36,594.00	0.02
398	600906	财达证券	4,900	36,554.00	0.02
399	600511	国药股份	1,400	36,456.00	0.02
400	600816	建元信托	14,900	36,356.00	0.02
401	600977	中国电影	2,800	36,176.00	0.02
402	601236	红塔证券	5,300	36,146.00	0.02
403	300100	双林股份	1,300	36,114.00	0.02
404	002244	滨江集团	4,700	35,720.00	0.02
405	600970	中材国际	5,000	35,650.00	0.02
406	688295	中复神鹰	580	35,113.20	0.02
407	600967	内蒙一机	3,200	34,720.00	0.02
408	300146	汤臣倍健	3,800	34,352.00	0.02
409	300144	宋城演艺	5,900	34,279.00	0.02
410	002568	百润股份	2,000	33,840.00	0.02
411	600131	国网信通	2,300	33,580.00	0.02
412	601866	中远海发	14,700	32,487.00	0.02
413	600095	湘财股份	4,300	32,379.00	0.02
414	000088	盐田港	7,800	31,902.00	0.02
415	002583	海能达	4,100	31,529.00	0.01
416	601118	海南橡胶	6,400	31,488.00	0.01
417	603737	三棵树	1,300	31,330.00	0.01
418	600126	杭钢股份	5,100	31,263.00	0.01
419	600801	华新建材	2,000	31,200.00	0.01
420	600566	济川药业	1,400	31,066.00	0.01
421	600871	石化油服	15,300	31,059.00	0.01
421	603000	人民网	2,100	31,059.00	0.01
423	688336	三生国健	577	30,638.70	0.01
424	600754	锦江酒店	1,700	30,583.00	0.01
425	300718	长盛轴承	500	30,485.00	0.01
426	688363	华熙生物	844	30,189.88	0.01
427	002984	森麒麟	2,300	30,061.00	0.01
428	688563	航材股份	585	29,969.55	0.01
429	603589	口子窖	1,600	29,888.00	0.01
430	000825	太钢不锈	8,600	29,326.00	0.01
431	603899	晨光股份	1,400	28,882.00	0.01
432	002423	中粮资本	3,500	28,805.00	0.01
433	601598	中国外运	5,800	28,768.00	0.01
434	002773	康弘药业	1,400	28,630.00	0.01
435	601966	玲珑轮胎	2,800	28,532.00	0.01

436	600004	白云机场	3,900	28,314.00	0.01
437	600350	山东高速	2,500	27,825.00	0.01
438	600848	上海临港	3,700	27,713.00	0.01
439	600663	陆家嘴	4,400	27,632.00	0.01
440	000429	粤高速 A	2,000	27,300.00	0.01
441	688708	佳驰科技	520	26,416.00	0.01
442	003021	兆威机电	300	26,205.00	0.01
443	600062	华润双鹤	1,600	25,664.00	0.01
444	600968	海油发展	7,700	25,641.00	0.01
445	601928	凤凰传媒	2,900	25,491.00	0.01
446	300957	贝泰妮	800	25,208.00	0.01
447	300888	稳健医疗	900	25,191.00	0.01
448	003035	南网能源	4,300	25,026.00	0.01
449	601808	中海油服	2,300	24,863.00	0.01
450	002508	老板电器	1,700	24,854.00	0.01
451	688425	铁建重工	6,032	24,248.64	0.01
452	688192	迪哲医药	607	24,237.51	0.01
453	002670	国盛证券	2,200	24,200.00	0.01
454	688709	成都华微	628	23,920.52	0.01
455	600098	广州发展	4,000	23,640.00	0.01
456	688561	奇安信	983	23,572.34	0.01
457	000539	粤电力 A	3,400	23,154.00	0.01
458	000537	绿发电力	3,100	22,661.00	0.01
459	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.01
460	600377	宁沪高速	1,900	21,983.00	0.01
461	600292	电投水电	1,800	21,672.00	0.01
462	603833	欧派家居	700	21,077.00	0.01
463	688520	神州细胞	612	20,936.52	0.01
464	601298	青岛港	2,600	20,930.00	0.01
465	000959	首钢股份	5,800	20,358.00	0.01
466	002608	江苏国信	2,900	20,010.00	0.01
467	301301	川宁生物	2,500	19,850.00	0.01
468	603529	爱玛科技	1,000	19,510.00	0.01
469	600339	中油工程	6,300	19,341.00	0.01
470	600606	绿地控股	15,900	19,239.00	0.01
471	002265	建设工业	1,100	19,140.00	0.01
472	600032	浙江新能	2,700	19,035.00	0.01
473	000785	居然智家	9,400	18,800.00	0.01
474	688475	萤石网络	683	18,680.05	0.01
475	603175	超颖电子	200	17,818.00	0.01
476	600764	中国海防	1,000	17,430.00	0.01

477	603658	安图生物	600	17,412.00	0.01
478	000898	鞍钢股份	9,000	16,830.00	0.01
479	603786	科博达	400	16,364.00	0.01
480	301498	乖宝宠物	400	16,236.00	0.01
481	601228	广州港	5,700	16,074.00	0.01
482	000937	冀中能源	4,000	15,920.00	0.01
483	603049	中策橡胶	300	13,443.00	0.01
484	002945	华林证券	1,000	13,430.00	0.01
485	688819	天能股份	590	13,098.00	0.01
486	002461	珠江啤酒	1,700	12,869.00	0.01
487	600299	安迪苏	1,500	11,775.00	0.01
488	603092	德力佳	200	10,794.00	0.01
489	001221	悍高集团	200	8,044.00	0.00
490	001386	马可波罗	400	5,664.00	0.00
491	601112	振石股份	202	3,553.18	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688008	澜起科技	3,980	1,233,402.00	0.59
2	603296	华勤技术	16,240	1,206,144.80	0.57
3	688521	芯原股份	3,245	1,204,349.30	0.57
4	301191	菲菱科思	10,600	1,203,630.00	0.57
5	688041	海光信息	3,222	1,193,106.60	0.57
6	000510	新金路	36,800	914,112.00	0.43
7	002440	闰土股份	82,300	843,575.00	0.40
8	002171	楚江新材	44,400	602,508.00	0.29
9	300687	赛意信息	19,400	601,400.00	0.29
10	688795	摩尔线程	886	599,768.84	0.28
11	605167	利柏特	35,100	565,110.00	0.27
12	600893	航发动力	14,700	563,598.00	0.27
13	600366	宁波韵升	37,200	546,096.00	0.26
14	000833	粤桂股份	23,300	545,686.00	0.26
15	603281	江瀚新材	13,100	532,253.00	0.25
16	688802	沐曦股份	666	512,080.74	0.24
17	002539	云图控股	44,000	498,080.00	0.24
18	600259	中稀有色	4,800	487,728.00	0.23
19	301666	大普微	549	254,368.17	0.12
20	688765	禾元生物	4,487	217,888.72	0.10
21	688808	联讯仪器	91	144,174.03	0.07
22	688781	视涯科技	3,258	137,357.28	0.07

23	001248	华润新能	11,718	118,468.98	0.06
24	688790	昂瑞微	725	91,676.25	0.04
25	688820	盛合晶微	530	74,989.70	0.04
26	301682	宏明电子	318	50,899.08	0.02
27	688818	电科蓝天	715	50,150.10	0.02
28	688809	强一股份	75	46,725.00	0.02
29	688797	臻宝科技	95	44,523.65	0.02
30	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.02
31	688635	长进光子	126	38,831.94	0.02
32	001399	惠科股份	1,278	35,438.94	0.02
33	688712	北芯生命	950	34,124.00	0.02
34	001257	盛龙股份	1,565	32,458.10	0.02
35	688785	恒运昌	54	25,010.10	0.01
36	603459	红板科技	243	20,489.76	0.01
37	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
38	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
39	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
40	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
41	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
42	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.01
43	001365	天海电子	360	11,271.60	0.01
44	301680	固德电材	91	10,206.56	0.00
45	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
46	001393	维通利	253	9,864.47	0.00
47	001237	惠康科技	137	8,047.38	0.00
48	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
49	688816	易思维	99	5,652.90	0.00
50	001369	双欣材料	410	5,543.20	0.00
51	603435	嘉德利	90	4,203.90	0.00
52	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
53	603293	埃泰克	66	2,239.38	0.00
54	001312	福恩股份	133	2,231.74	0.00
55	603352	至信股份	78	1,990.56	0.00
56	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
57	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	600988	赤峰黄金	25,606,101.84	11.77
2	600549	厦门钨业	19,582,785.10	9.00
3	000657	中钨高新	18,939,207.00	8.70
4	000960	锡业股份	18,513,104.00	8.51
5	688347	华虹宏力	18,025,019.44	8.28
6	000933	神火股份	16,710,924.60	7.68
7	603444	吉比特	16,617,532.00	7.64
8	300496	中科创达	15,489,727.00	7.12
9	688281	华秦科技	15,459,757.85	7.11
10	002185	华天科技	15,009,802.07	6.90
11	000893	亚钾国际	14,865,754.00	6.83
12	300857	协创数据	14,571,544.45	6.70
13	300136	信维通信	14,388,490.00	6.61
14	601615	明阳智能	14,283,532.00	6.56
15	603979	金诚信	14,100,665.00	6.48
16	002532	天山铝业	13,993,002.00	6.43
17	688002	睿创微纳	13,864,147.68	6.37
18	000510	新金路	13,090,037.60	6.02
19	600498	烽火通信	13,015,650.00	5.98
20	002281	光迅科技	12,871,251.00	5.92
21	688525	佰维存储	12,666,403.39	5.82
22	600685	中船防务	12,664,666.85	5.82
23	300454	深信服	12,271,534.93	5.64
24	002008	大族激光	12,254,989.85	5.63
25	002414	高德红外	12,249,159.88	5.63
26	603659	璞泰来	12,205,067.00	5.61
27	002517	恺英网络	12,145,499.00	5.58
28	600487	亨通光电	11,999,435.74	5.51
29	300073	当升科技	11,709,023.00	5.38
30	002410	广联达	11,309,486.00	5.20
31	002583	海能达	11,147,915.00	5.12
32	601958	金钼股份	10,753,652.00	4.94
33	301358	湖南裕能	10,542,660.54	4.85
34	600499	科达制造	10,468,368.00	4.81
35	600038	中直股份	10,376,358.00	4.77
36	002064	华峰化学	10,273,110.00	4.72
37	688692	达梦数据	10,218,602.14	4.70
38	300223	君正股份	10,108,078.00	4.65
39	688615	合合信息	9,821,584.57	4.51
40	600879	航天电子	9,740,770.00	4.48
41	600885	宏发股份	9,713,150.19	4.46

42	600623	华谊集团	9,665,450.00	4.44
43	603486	科沃斯	9,418,437.00	4.33
44	002156	通富微电	9,407,012.00	4.32
45	688099	晶晨股份	9,180,844.03	4.22
46	300957	贝泰妮	9,166,237.00	4.21
47	000831	中国稀土	8,654,647.00	3.98
48	002202	金风科技	8,642,145.00	3.97
49	300458	全志科技	8,605,495.49	3.95
50	688213	思特威	8,573,364.08	3.94
51	300373	扬杰科技	8,555,203.00	3.93
52	002558	巨人网络	8,465,126.00	3.89
53	603393	新天然气	8,297,761.00	3.81
54	300604	长川科技	8,220,666.00	3.78
55	002738	中矿资源	8,178,336.00	3.76
56	600546	山煤国际	8,152,875.00	3.75
57	002850	科达利	8,080,943.00	3.71
58	603379	三美股份	7,936,744.00	3.65
59	601168	西部矿业	7,858,750.00	3.61
60	000887	中鼎股份	7,839,317.84	3.60
61	300012	华测检测	7,836,045.00	3.60
62	603345	安井食品	7,804,267.15	3.59
63	301536	星宸科技	7,778,616.00	3.57
64	002595	豪迈科技	7,756,114.40	3.56
65	002756	永兴材料	7,640,427.00	3.51
66	300037	新宙邦	7,631,445.00	3.51
67	601799	星宇股份	7,503,757.00	3.45
68	300207	欣旺达	7,437,726.00	3.42
69	600884	杉杉股份	7,414,199.00	3.41
70	688578	艾力斯	7,389,901.69	3.40
71	000738	航发控制	7,379,203.00	3.39
72	603606	东方电缆	7,263,440.40	3.34
73	002128	电投能源	7,179,653.00	3.30
74	600143	金发科技	7,040,485.00	3.24
75	600166	福田汽车	7,038,935.00	3.24
76	688387	信科移动	6,955,641.11	3.20
77	603699	纽威股份	6,949,633.00	3.19
78	000951	中国重汽	6,846,525.00	3.15
79	600171	上海贝岭	6,833,490.00	3.14
80	002203	海亮股份	6,804,628.00	3.13
81	600563	法拉电子	6,771,649.00	3.11
82	000733	振华科技	6,767,865.00	3.11

83	688469	芯联集成	6,505,129.66	2.99
84	300972	万辰集团	6,467,251.00	2.97
85	600426	华鲁恒升	6,404,336.00	2.94
86	002603	以岭药业	6,354,081.00	2.92
87	688728	格科微	6,335,791.11	2.91
88	002378	章源钨业	6,281,893.00	2.89
89	601216	君正集团	6,281,096.00	2.89
90	600256	广汇能源	6,072,236.00	2.79
91	688521	芯原股份	6,060,471.63	2.79
92	688322	奥比中光	6,052,343.12	2.78
93	600329	达仁堂	5,982,170.00	2.75
94	601128	常熟银行	5,864,920.00	2.70
95	688041	海光信息	5,863,482.19	2.69
96	603233	大参林	5,838,661.44	2.68
97	600765	中航重机	5,794,916.00	2.66
98	688543	国科军工	5,786,889.02	2.66
99	300450	先导智能	5,780,232.00	2.66
100	001309	德明利	5,760,125.00	2.65
101	002246	北化股份	5,721,902.00	2.63
102	000519	中兵红箭	5,677,486.00	2.61
103	600352	浙江龙盛	5,531,646.00	2.54
104	600989	宝丰能源	5,507,544.00	2.53
105	300919	中伟新材	5,422,828.28	2.49
106	000426	兴业银锡	5,421,792.00	2.49
107	300118	东方日升	5,420,007.00	2.49
108	600096	云天化	5,388,590.00	2.48
109	601019	山东出版	5,315,512.00	2.44
110	688019	安集科技	5,302,335.55	2.44
111	600517	国网英大	5,173,379.00	2.38
112	300676	华大基因	5,146,980.00	2.37
113	600893	航发动力	5,125,964.00	2.36
114	300140	节能环保	5,104,646.00	2.35
115	000729	燕京啤酒	5,095,524.00	2.34
116	600801	华新建材	5,041,138.00	2.32
117	603596	伯特利	4,983,154.00	2.29
118	300474	景嘉微	4,933,479.00	2.27
119	600332	白云山	4,915,156.00	2.26
120	601233	桐昆股份	4,908,163.00	2.26
121	600060	海信视像	4,885,651.00	2.25
122	605598	上海港湾	4,853,391.00	2.23
123	601869	长飞光纤	4,811,577.56	2.21

124	688361	中科飞测	4,792,294.15	2.20
125	002155	湖南黄金	4,674,362.00	2.15
126	688037	芯源微	4,650,361.55	2.14
127	000027	深圳能源	4,649,233.00	2.14
128	603049	中策橡胶	4,645,642.00	2.14
129	300003	乐普医疗	4,641,056.00	2.13
130	002487	大金重工	4,638,015.00	2.13
131	600301	华锡有色	4,604,871.00	2.12
132	300432	富临精工	4,587,216.00	2.11
133	688188	柏楚电子	4,559,345.65	2.10
134	300570	太辰光	4,524,893.58	2.08
135	601717	中创智领	4,520,099.00	2.08
136	601139	深圳燃气	4,500,163.00	2.07
137	600598	北大荒	4,473,980.00	2.06
138	603766	隆鑫通用	4,472,845.00	2.06
139	000783	长江证券	4,387,054.00	2.02

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600988	赤峰黄金	30,494,074.00	14.01
2	000657	中钨高新	21,379,342.98	9.83
3	600549	厦门钨业	20,182,356.00	9.28
4	688347	华虹宏力	19,275,491.86	8.86
5	000893	亚钾国际	18,889,852.60	8.68
6	002185	华天科技	18,757,242.20	8.62
7	000960	锡业股份	18,735,350.00	8.61
8	300136	信维通信	16,336,805.69	7.51
9	603979	金诚信	16,274,102.00	7.48
10	000933	神火股份	16,210,939.00	7.45
11	688281	华秦科技	15,867,193.35	7.29
12	603444	吉比特	15,837,464.00	7.28
13	002281	光迅科技	14,780,826.00	6.79
14	600498	烽火通信	14,479,256.00	6.65
15	300857	协创数据	14,311,080.35	6.58
16	002156	通富微电	14,251,209.00	6.55
17	300496	中科创达	14,205,301.67	6.53
18	300454	深信服	13,544,030.15	6.22
19	002008	大族激光	13,357,023.00	6.14

20	002532	天山铝业	13,318,546.00	6.12
21	688002	睿创微纳	13,316,083.31	6.12
22	000510	新金路	12,833,084.32	5.90
23	601615	明阳智能	12,772,920.00	5.87
24	688525	佰维存储	12,574,070.06	5.78
25	600096	云天化	12,515,030.00	5.75
26	300373	扬杰科技	12,378,736.00	5.69
27	600487	亨通光电	11,832,525.00	5.44
28	603659	璞泰来	11,747,256.80	5.40
29	002410	广联达	11,565,076.00	5.32
30	600885	宏发股份	11,312,524.80	5.20
31	002517	恺英网络	11,309,012.00	5.20
32	688692	达梦数据	11,127,524.72	5.11
33	601958	金钼股份	10,878,830.00	5.00
34	600879	航天电子	10,784,833.00	4.96
35	300223	君正股份	10,740,673.95	4.94
36	600685	中船防务	10,614,648.00	4.88
37	002583	海能达	10,487,125.68	4.82
38	300458	全志科技	10,392,820.09	4.78
39	300207	欣旺达	10,377,889.00	4.77
40	300012	华测检测	10,367,436.00	4.76
41	002414	高德红外	10,323,201.84	4.74
42	002155	湖南黄金	10,180,837.70	4.68
43	600499	科达制造	10,161,232.00	4.67
44	600038	中直股份	10,113,687.00	4.65
45	603379	三美股份	10,107,580.00	4.65
46	603486	科沃斯	10,017,469.00	4.60
47	300073	当升科技	9,796,739.88	4.50
48	688213	思特威	9,696,523.11	4.46
49	600884	杉杉股份	9,422,436.00	4.33
50	002595	豪迈科技	9,369,882.80	4.31
51	301358	湖南裕能	9,343,686.00	4.29
52	002202	金风科技	9,218,587.00	4.24
53	600623	华谊集团	9,109,248.00	4.19
54	002558	巨人网络	8,976,079.00	4.13
55	000887	中鼎股份	8,795,191.48	4.04
56	688615	合合信息	8,785,165.60	4.04
57	300957	贝泰妮	8,720,881.00	4.01
58	300604	长川科技	8,719,090.00	4.01
59	300972	万辰集团	8,624,896.00	3.96
60	688578	艾力斯	8,424,369.04	3.87

61	601168	西部矿业	8,397,882.00	3.86
62	002850	科达利	8,273,626.00	3.80
63	603699	纽威股份	8,218,838.00	3.78
64	600546	山煤国际	8,205,695.00	3.77
65	603345	安井食品	7,996,384.10	3.68
66	601799	星宇股份	7,912,549.00	3.64
67	000831	中国稀土	7,912,511.00	3.64
68	300037	新宙邦	7,872,893.60	3.62
69	002738	中矿资源	7,847,855.22	3.61
70	002064	华峰化学	7,803,469.00	3.59
71	600166	福田汽车	7,771,729.00	3.57
72	603606	东方电缆	7,501,630.40	3.45
73	688183	生益电子	7,157,135.69	3.29
74	000733	振华科技	7,094,577.00	3.26
75	000951	中国重汽	6,793,200.00	3.12
76	002128	电投能源	6,762,879.00	3.11
77	600563	法拉电子	6,752,873.62	3.10
78	600329	达仁堂	6,748,370.00	3.10
79	603596	伯特利	6,721,200.40	3.09
80	688469	芯联集成	6,695,864.96	3.08
81	300118	东方日升	6,623,905.08	3.04
82	300003	乐普医疗	6,584,547.00	3.03
83	002203	海亮股份	6,504,651.00	2.99
84	603393	新天然气	6,438,869.00	2.96
85	688099	晶晨股份	6,437,107.99	2.96
86	600143	金发科技	6,396,716.00	2.94
87	600801	华新建材	6,377,813.31	2.93
88	000519	中兵红箭	6,372,387.90	2.93
89	688387	信科移动	6,345,802.38	2.92
90	688322	奥比中光	6,338,569.81	2.91
91	301536	星宸科技	6,335,746.00	2.91
92	601717	中创智领	6,320,132.00	2.90
93	688543	国科军工	6,048,015.69	2.78
94	601019	山东出版	6,022,408.00	2.77
95	002378	章源钨业	6,021,764.00	2.77
96	601128	常熟银行	6,012,815.00	2.76
97	000738	航发控制	5,995,775.00	2.76
98	688521	芯原股份	5,983,755.69	2.75
99	002246	北化股份	5,900,764.00	2.71
100	600517	国网英大	5,872,789.00	2.70
101	600765	中航重机	5,851,872.00	2.69

102	300474	景嘉微	5,850,240.00	2.69
103	601233	桐昆股份	5,637,972.00	2.59
104	600256	广汇能源	5,584,939.00	2.57
105	000729	燕京啤酒	5,564,484.00	2.56
106	600426	华鲁恒升	5,534,370.00	2.54
107	300450	先导智能	5,525,807.83	2.54
108	603233	大参林	5,504,517.00	2.53
109	002195	岩山科技	5,475,942.00	2.52
110	600352	浙江龙盛	5,381,920.00	2.47
111	600332	白云山	5,364,909.00	2.47
112	002756	永兴材料	5,354,157.00	2.46
113	601216	君正集团	5,335,827.00	2.45
114	600301	华锡有色	5,307,800.00	2.44
115	000426	兴业银锡	5,243,086.00	2.41
116	600060	海信视像	5,228,860.60	2.40
117	002603	以岭药业	5,221,852.00	2.40
118	603160	汇顶科技	5,212,492.68	2.40
119	600131	国网信通	5,206,777.00	2.39
120	000783	长江证券	5,139,739.00	2.36
121	688019	安集科技	5,131,757.16	2.36
122	601865	福莱特	5,085,490.00	2.34
123	600989	宝丰能源	5,014,350.00	2.30
124	000932	华菱钢铁	4,939,099.00	2.27
125	688041	海光信息	4,887,942.79	2.25
126	000050	深天马 A	4,842,699.00	2.23
127	600893	航发动力	4,769,448.00	2.19
128	300919	中伟新材	4,760,993.44	2.19
129	601156	东航物流	4,756,452.04	2.19
130	688188	柏楚电子	4,554,833.60	2.09
131	603049	中策橡胶	4,517,690.00	2.08
132	601231	环旭电子	4,507,432.00	2.07
133	002565	顺灏股份	4,502,504.00	2.07
134	301200	大族数控	4,495,921.00	2.07
135	002465	海格通信	4,495,188.00	2.07
136	601000	唐山港	4,466,057.00	2.05
137	688361	中科飞测	4,460,447.99	2.05
138	300140	节能环保	4,458,765.00	2.05
139	001286	陕西能源	4,364,472.00	2.01

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,865,016,452.33
卖出股票收入（成交）总额	1,900,371,646.29

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,051,855.34	3.82
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	2,000.04	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	8,053,855.38	3.82

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	80,000	8,051,855.34	3.82
2	118071	华峰转债	20	2,000.04	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投

资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,343,859.20
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	462,826.61
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,806,685.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
中信保诚 中证 500 指 数增强 A	1,062	33,975.85	9,850,573.58	27.30%	26,231,774.72	72.70%
中信保诚 中证 500 指 数增强 C	3,022	28,229.04	209,025.27	0.25%	85,099,143.10	99.75%
合计	4,084	29,723.44	10,059,598.85	8.29%	111,330,917.82	91.71%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚中证 500 指数增强 A	86,013.33	0.24%
	中信保诚中证 500 指数增强 C	35,170.81	0.04%
	合计	121,184.14	0.10%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 06 月 21 日）基金份额总额	54,506,399.98	164,837,915.71
本报告期期初基金份额总额	31,913,115.92	104,549,966.61
本报告期基金总申购份额	53,403,696.89	418,577,355.80
减：本报告期基金总赎回份额	49,234,464.51	437,819,154.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,082,348.30	85,308,168.37

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	957,936,252.56	25.45%	192,881.92	25.46%	—

中信证券	2	2,805,838,372.97	74.55%	564,771.89	74.54%	-
------	---	------------------	--------	------------	--------	---

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	2,000.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中信证券	40,001,460.00	100.00%	31,800,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年01月21日
2	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026年03月30日
3	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026年04月21日
4	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2026年05月29日
5	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2026年05月29日

6	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 5 月）	同上	2026年05月29日
---	---	----	-------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日