

中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金  
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自2025年06月30日（基金合同生效日）起至2025年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>15</b>
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	18
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	56
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证 A500 指数增强	
基金主代码	023503	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 06 月 30 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,725,469.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投中证 A500 指数增强 A	中信建投中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023503	023504
报告期末下属分级基金的份额总额	8,481,742.47 份	15,243,726.53 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证 A500 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力争实现超额收益。</p>
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	朱伟	朱萍
	联系电话	010-59100208	021-31888888
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95528
传真		010-59100298	021-63602540
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		100010	200126
法定代表人		黄凌	张为忠

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日	
	中信建投中证 A500 指数增强 A	中信建投中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	4,067,730.40	6,780,659.90
本期利润	4,282,948.67	7,290,990.98
加权平均基金份额本期利润	0.1513	0.1092
本期加权平均净值利润率	14.47%	10.58%
本期基金份额净值增长率	12.20%	11.97%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	1,034,685.19	1,824,890.57

期末可供分配基金份额利润	0.1220	0.1197
期末基金资产净值	9,516,427.66	17,068,617.10
期末基金份额净值	1.1220	1.1197
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	12.20%	11.97%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 中信建投中证 A500 指数增强 A 净值表现

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	0.39%	0.92%	0.43%	1.00%	-0.04%	-0.08%
过去六个月	12.20%	0.80%	20.71%	0.95%	-8.51%	-0.15%
自基金合同生效起至今	12.20%	0.80%	21.43%	0.95%	-9.23%	-0.15%

##### 中信建投中证 A500 指数增强 C 净值表现

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	0.29%	0.92%	0.43%	1.00%	-0.14%	-0.08%
过去六个月	11.97%	0.80%	20.71%	0.95%	-8.74%	-0.15%
自基金合同生效起至今	11.97%	0.80%	21.43%	0.95%	-9.46%	-0.15%

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

中信建投中证A500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年06月30日-2025年12月31日)



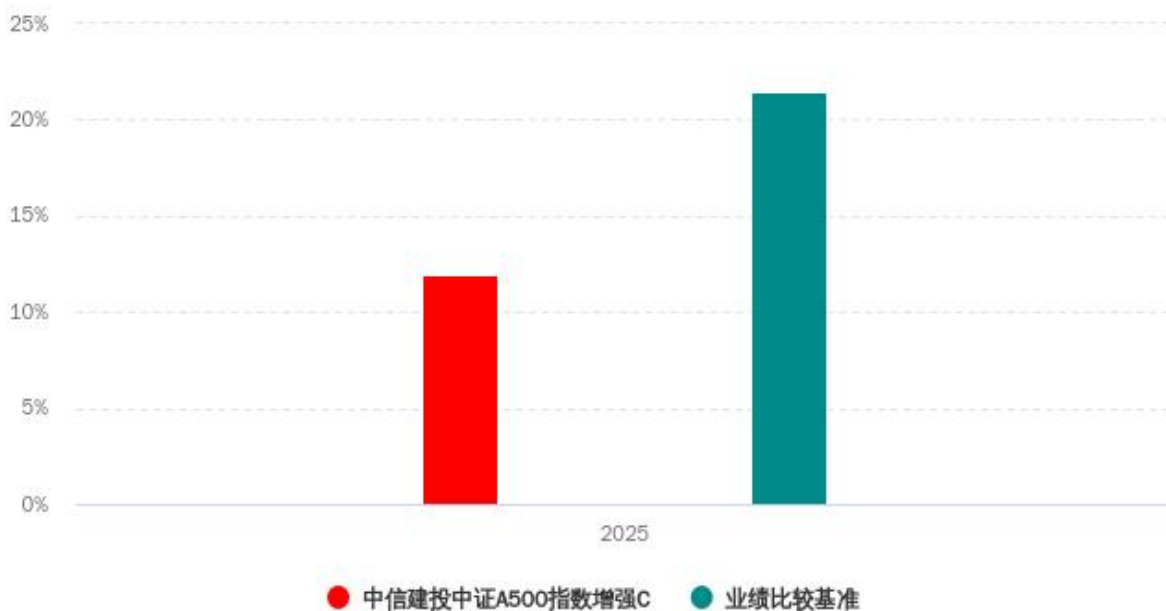
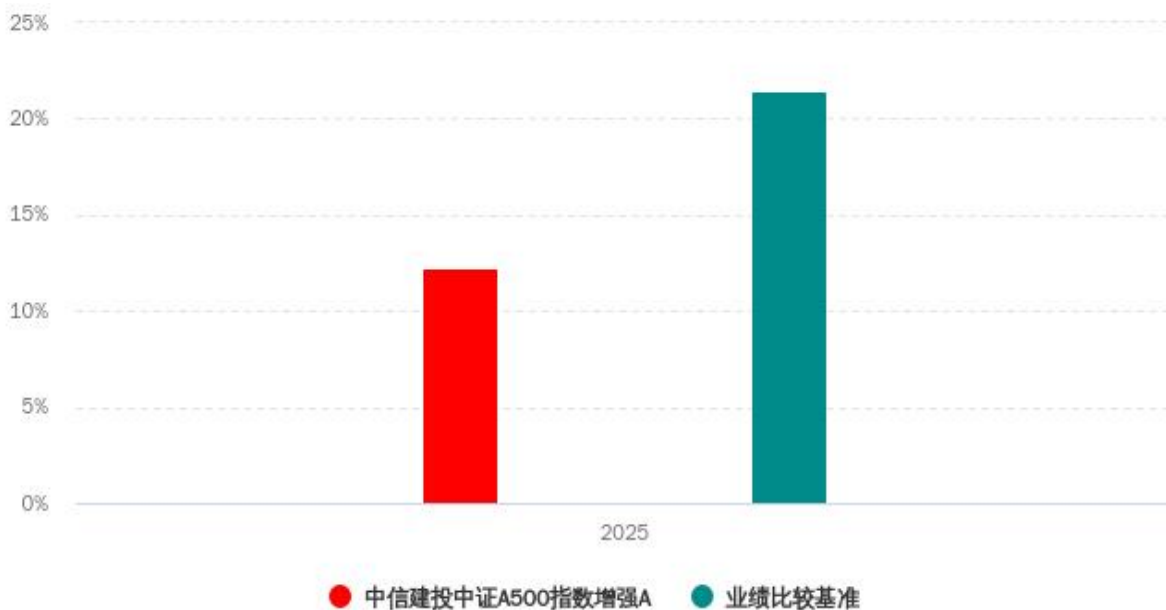
中信建投中证A500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年06月30日-2025年12月31日)



注：1、本基金于 2025 年 6 月 30 日合同生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。  
 2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月为建仓期，建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的相关约定。

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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 68 个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理	2025-06-30	-	10 年	中国籍，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019 年 2 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金、中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型

					证券投资基金、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年 A 股市场整体呈现震荡运行特征，在宏观经济修复节奏、政策预期变化以及海外流动性环境波动等因素影响下，市场风格出现阶段性轮动。整体来看，个股分化仍然较为明显，为量化选股策略获取超额收益提供了一定空间，但市场波动与风格切换也对模型稳定性提出了更高要求。

报告期内，本基金继续坚持指数增强投资策略，在严格控制组合相对指数跟踪误差的前提下，

通过量化选股模型力争获取稳定超额收益。组合整体保持与标的指数较高相关性，同时在风险预算范围内进行适度主动配置。

在选股模型方面，本基金持续运行多因子选股体系，因子主要涵盖盈利质量、成长能力、估值水平以及量价行为等维度。报告期内，管理人结合市场环境变化对部分因子结构进行了适度优化，并加强了对因子稳定性与拥挤度的监测，以提升模型在不同市场环境下的适应能力。

在组合构建方面，本基金通过量化优化方法进行系统化配置，在控制行业偏离、风格暴露及个股权重的前提下，力求提升组合的风险收益比。同时通过适度分散持仓以降低个股波动对组合的影响。

在风险管理方面，本基金持续监控组合行业与风格暴露，动态调整风险预算，在市场波动阶段加强组合回撤控制，整体保持了相对稳健的运行状态。

整体来看，报告期内本基金在保持指数跟踪效果稳定的基础上，通过量化模型获取了一定的超额收益。未来管理人将继续优化模型与组合管理体系，以提升策略的稳定性与持续获取超额收益的能力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.1220 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 12.20%，同期业绩比较基准收益率为 21.43%；截至报告期末中信建投中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1197 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 11.97%，同期业绩比较基准收益率为 21.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，短期来看，A 股市场预计仍将维持震荡运行格局。宏观经济处于逐步修复阶段，政策环境整体保持稳健，市场风险偏好有望在基本面改善与政策预期推动下逐步修复。但在海外经济周期变化及全球流动性环境仍存在不确定性的背景下，市场波动可能仍将维持在一定水平。

从基本面角度看，随着需求逐步企稳以及部分行业供给结构持续优化，企业盈利有望逐步改善。与此同时，资本市场改革持续推进，长期资金入市及市场制度不断完善，将有助于提升市场定价效率和市场稳定性。

对于量化投资而言，市场结构性分化仍将为量化选股策略提供超额收益来源，但市场风格变化也要求策略持续进行模型优化与风险管理。未来，本基金将继续在严格控制跟踪误差和组合风险暴露的前提下，通过持续优化量化模型与组合管理体系，力争实现稳定的指数增强效果。

中长期来看，在经济结构转型与资本市场制度持续完善的背景下，中国资本市场仍具备较好的配置价值，市场长期发展基础依然稳固。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，

促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

本基金自 2025 年 10 月 28 日起出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，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、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中信建投基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70069507_A58 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投中</p>

	<p>证 A500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及</p>

	<p>相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2026-03-30

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	1,923,439.05
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	24,768,262.75
其中：股票投资		24,752,562.50
基金投资		-
债券投资		15,700.25
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-

应收股利		-
应收申购款		11,763.15
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		26,703,464.95
<b>负债和净资产</b>		<b>附注号</b>
本期末 2025 年 12 月 31 日		
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		15,059.36
应付管理人报酬		19,309.46
应付托管费		2,413.68
应付销售服务费		6,169.51
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	75,468.18
负债合计		118,420.19
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	23,725,469.00
未分配利润	7.4.7.8	2,859,575.76
净资产合计		26,585,044.76
负债和净资产总计		26,703,464.95

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 23,725,469.00 份，其中中信建投中证 A500 指数增强 A 类基金份额净值 1.1220 元，基金份额 8,481,742.47 份；中信建投中证 A500 指数增强 C 类基金份额净值 1.1197 元，基金份额 15,243,726.53 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		12,217,922.98
1. 利息收入		76,866.22

其中：存款利息收入	7.4.7.9	76,866.22
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,195,172.96
其中：股票投资收益	7.4.7.10	10,730,711.46
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	1.91
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.12	464,459.59
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	725,549.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	220,334.45
<b>减：二、营业总支出</b>		643,983.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	386,042.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	48,255.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	133,885.61
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.15	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.16	75,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,573,939.65
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,573,939.65
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		11,573,939.65

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	235,744,440.82	-	235,744,440.82

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-212,018,971.82	2,859,575.76	-209,159,396.06
(一)、综合收益总额	-	11,573,939.65	11,573,939.65
(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)	-212,018,971.82	-8,714,363.89	-220,733,335.71
其中：1. 基金申购款	10,964,226.65	1,010,672.63	11,974,899.28
2. 基金赎回款	-222,983,198.47	-9,725,036.52	-232,708,234.99
(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	23,725,469.00	2,859,575.76	26,585,044.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄凌	张欣宇	谭保民
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2025)265号《关于准予中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的运作方式为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 235,692,150.17 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2500469 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 235,744,440.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 52,290.65 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不收取销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为估值日各类别基金资产净值除以估值日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要包括标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为

更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号〈年度报告的内容与格式〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币

元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获

得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持

有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管

理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	153,258.98
等于：本金	153,212.10
加：应计利息	46.88
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	1,770,180.07
等于：本金	1,770,129.73
加：应计利息	50.34
减：坏账准备	-
合计	1,923,439.05

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	24,033,711.49	-	24,752,562.50	718,851.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,000.00	1.91	15,700.25	6,698.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,000.00	1.91	15,700.25	6,698.34
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	24,042,711.49	1.91	24,768,262.75	725,549.35	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.18
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	-
预提费用	75,000.00
其他应付	468.00
合计	75,468.18

7.4.7.7 实收基金

中信建投中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	54,468,430.15	54,468,430.15
本期申购	7,078,658.48	7,078,658.48
本期赎回（以“-”号填列）	-53,065,346.16	-53,065,346.16
本期末	8,481,742.47	8,481,742.47

中信建投中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	181,276,010.67	181,276,010.67
本期申购	3,885,568.17	3,885,568.17
本期赎回（以“-”号填列）	-169,917,852.31	-169,917,852.31

本期末	15,243,726.53	15,243,726.53
-----	---------------	---------------

注：1、申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。  
 2、本基金自 2025 年 6 月 12 日至 2025 年 6 月 26 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 235,692,150.17 元，折合为 235,692,150.17 份基金份额（其中 A 类基金份额 54,454,545.23 份，C 类基金份额 181,237,604.94 份）。根据《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 52,290.65 元，在本基金成立后，折合为 52,290.65 份基金份额（其中 A 类基金份额 13,884.92 份，C 类基金份额 38,405.73 份），划入基金份额持有人账户。  
 3、根据《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》、《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2025 年 6 月 30 日(基金合同生效日)至 2025 年 7 月 31 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购、赎回、定期定额投资业务自 2025 年 8 月 1 日起开始办理。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 中信建投中证 A500 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,067,730.40	215,218.27	4,282,948.67
本期基金份额交易产生的变动数	-2,663,808.45	-584,455.03	-3,248,263.48
其中：基金申购款	619,226.76	91,179.60	710,406.36
基金赎回款	-3,283,035.21	-675,634.63	-3,958,669.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,403,921.95	-369,236.76	1,034,685.19

##### 中信建投中证 A500 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,780,659.90	510,331.08	7,290,990.98
本期基金份额交易	-4,293,238.93	-1,172,861.48	-5,466,100.41

产生的变动数			
其中：基金申购款	277,427.88	22,838.39	300,266.27
基金赎回款	-4,570,666.81	-1,195,699.87	-5,766,366.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,487,420.97	-662,530.40	1,824,890.57

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	59,613.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,252.51
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	76,866.22

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	280,798,589.42
减：卖出股票成本总额	269,780,598.07
减：交易费用	287,279.89
买卖股票差价收入	10,730,711.46

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	1.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1.91

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	464,459.59
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	464,459.59

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	725,549.35
——股票投资	718,851.01
——债券投资	6,698.34
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	725,549.35

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	220,334.45
合计	220,334.45

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

7.4.7.15 信用减值损失

无。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	15,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
证券账户开户费	800.00
合计	75,800.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	135,901,540.30	23.70%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	26,140.91	23.68%	-	-

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	386,042.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	186,720.33
应支付基金管理人的净管理费	199,322.11

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至
----	-------------------------------

	2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,255.28

注：支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证 A500 指数增强 A	中信建投中证 A500 指数增强 C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	20,412.62	20,412.62
上海浦东发展银行股份有限公司	-	56,033.50	56,033.50
合计	-	76,446.12	76,446.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司-托管户	153,258.98	59,613.71
中信建投证券股份有限公司-证	995,756.17	5,700.28

券户		
----	--	--

注：本基金托管账户的存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	1,300	99,232.71	102,453.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项	272.72	2026-01-05	278.00	300	77,073.34	81,816.00	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无余额。

**7.4.13.2.4 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 2025 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	15,700.25
未评级	-
合计	15,700.25

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无余额。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无余额。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

于本期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12（如有）。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。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,923,439.05	-	-	-	1,923,439.05
交易性金融资产	-	-	15,700.25	24,752,562.50	24,768,262.75
应收申购款	-	-	-	11,763.15	11,763.15
资产总计	1,923,439.05	-	15,700.25	24,764,325.65	26,703,464.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,059.36	15,059.36
应付管理人报酬	-	-	-	19,309.46	19,309.46
应付托管费	-	-	-	2,413.68	2,413.68
应付销售服务费	-	-	-	6,169.51	6,169.51
其他负债	-	-	-	75,468.18	75,468.18
负债总计	-	-	-	118,420.19	118,420.19
利率敏感度缺口	1,923,439.05	-	15,700.25	24,645,905.46	26,585,044.76

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,752,562.50	93.11
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,700.25	0.06
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	24,768,262.75	93.17

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
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 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,080,660.52
	业绩比较基准下降 5%	-1,080,660.52

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日
第一层次	24,583,993.75
第二层次	184,269.00
第三层次	-
合计	24,768,262.75

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,752,562.50	92.69
	其中：股票	24,752,562.50	92.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,700.25	0.06
	其中：债券	15,700.25	0.06
	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	1,923,439.05	7.20
8	其他各项资产	11,763.15	0.04
9	合计	26,703,464.95	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	65,754.00	0.25
B	采矿业	1,440,286.00	5.42
C	制造业	11,913,191.30	44.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	809,203.00	3.04
E	建筑业	521,877.00	1.96
F	批发和零售业	329,397.00	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,009,511.00	3.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	854,285.00	3.21
J	金融业	3,190,370.00	12.00
K	房地产业	198,233.00	0.75
L	租赁和商务服务业	365,880.00	1.38
M	科学研究和技术服务业	135,960.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	65,988.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,899,935.30	78.62

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	50,895.00	0.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,477,217.20	9.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,388.00	0.27
E	建筑业	52,622.00	0.20
F	批发和零售业	162,690.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	330,991.00	1.25
J	金融业	496,840.00	1.87
K	房地产业	157,108.00	0.59
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	51,876.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	3,852,627.20	14.49

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,700	991,602.00	3.73
2	600519	贵州茅台	500	688,590.00	2.59
3	601318	中国平安	9,400	642,960.00	2.42
4	601899	紫金矿业	13,100	451,557.00	1.70

5	600036	招商银行	10,400	437,840.00	1.65
6	300308	中际旭创	700	427,000.00	1.61
7	601166	兴业银行	17,800	374,868.00	1.41
8	300059	东方财富	14,700	340,746.00	1.28
9	000333	美的集团	4,100	320,415.00	1.21
10	600900	长江电力	9,900	269,181.00	1.01
11	000651	格力电器	5,500	221,210.00	0.83
12	600887	伊利股份	7,700	220,220.00	0.83
13	601328	交通银行	30,300	219,675.00	0.83
14	002475	立讯精密	3,700	209,827.00	0.79
15	600030	中信证券	7,300	209,583.00	0.79
16	300274	阳光电源	1,200	205,248.00	0.77
17	601398	工商银行	24,700	195,871.00	0.74
18	002594	比亚迪	2,000	195,440.00	0.74
19	600276	恒瑞医药	3,100	184,667.00	0.69
20	000725	京东方 A	43,700	183,977.00	0.69
21	601816	京沪高铁	35,200	181,280.00	0.68
22	601601	中国太保	4,300	180,213.00	0.68
23	688981	中芯国际	1,400	171,962.00	0.65
24	000063	中兴通讯	4,500	170,280.00	0.64
25	601857	中国石油	16,200	168,642.00	0.63
26	601288	农业银行	21,700	166,656.00	0.63
27	002384	东山精密	1,800	152,370.00	0.57
28	000425	徐工机械	13,100	151,698.00	0.57
29	603501	豪威集团	1,200	151,080.00	0.57
30	601728	中国电信	23,200	146,160.00	0.55
31	002463	沪电股份	2,000	146,140.00	0.55
32	600690	海尔智家	5,600	146,104.00	0.55
33	601668	中国建筑	27,800	142,614.00	0.54
34	601888	中国中免	1,500	141,840.00	0.53
35	300014	亿纬锂能	2,100	138,096.00	0.52
36	002371	北方华创	300	137,724.00	0.52
37	000858	五粮液	1,300	137,722.00	0.52
38	000338	潍柴动力	8,000	137,600.00	0.52
39	603259	药明康德	1,500	135,960.00	0.51
40	688256	寒武纪	100	135,555.00	0.51
41	600028	中国石化	21,700	134,106.00	0.50
42	002625	光启技术	2,700	131,652.00	0.50
43	600406	国电南瑞	5,800	130,384.00	0.49
44	000100	TCL 科技	28,700	130,298.00	0.49
45	600418	江淮汽车	2,600	128,700.00	0.48
46	600150	中国船舶	3,837	127,618.62	0.48
47	002027	分众传媒	16,800	123,816.00	0.47

48	688041	海光信息	548	122,976.68	0.46
49	601628	中国人寿	2,700	122,850.00	0.46
50	600938	中国海油	4,000	120,720.00	0.45
51	002241	歌尔股份	4,200	120,666.00	0.45
52	601766	中国中车	17,500	119,350.00	0.45
53	000988	华工科技	1,500	118,995.00	0.45
54	600050	中国联通	23,200	118,552.00	0.45
55	300476	胜宏科技	400	115,032.00	0.43
56	600489	中金黄金	4,900	114,464.00	0.43
57	600019	宝钢股份	15,000	111,750.00	0.42
58	000408	藏格矿业	1,300	109,720.00	0.41
59	601658	邮储银行	19,900	108,455.00	0.41
60	600905	三峡能源	26,200	107,158.00	0.40
61	601006	大秦铁路	20,700	106,812.00	0.40
62	600104	上汽集团	6,900	105,018.00	0.40
63	600438	通威股份	5,100	104,652.00	0.39
64	600362	江西铜业	1,900	104,348.00	0.39
65	002049	紫光国微	1,300	102,453.00	0.39
66	601390	中国中铁	18,800	101,708.00	0.38
67	300058	蓝色光标	8,700	100,224.00	0.38
68	600160	巨化股份	2,600	99,892.00	0.38
69	601168	西部矿业	3,600	99,504.00	0.37
70	600585	海螺水泥	4,500	98,370.00	0.37
71	600426	华鲁恒升	3,100	97,433.00	0.37
72	600988	赤峰黄金	3,100	96,844.00	0.36
73	600570	恒生电子	3,200	96,480.00	0.36
74	600048	保利发展	15,800	96,380.00	0.36
75	000933	神火股份	3,500	96,145.00	0.36
76	600115	中国东航	16,000	96,000.00	0.36
77	600795	国电电力	19,000	95,760.00	0.36
78	000001	平安银行	8,300	94,703.00	0.36
79	600989	宝丰能源	4,800	94,224.00	0.35
80	000157	中联重科	10,800	93,204.00	0.35
81	002179	中航光电	2,600	92,144.00	0.35
82	600309	万华化学	1,200	92,016.00	0.35
83	603993	洛阳钼业	4,600	92,000.00	0.35
84	002001	新和成	3,600	90,684.00	0.34
85	600176	中国巨石	5,300	90,630.00	0.34
86	601058	赛轮轮胎	5,600	90,608.00	0.34
87	300124	汇川技术	1,200	90,396.00	0.34
88	300207	欣旺达	3,400	88,910.00	0.33
89	600011	华能国际	11,900	88,774.00	0.33
90	600885	宏发股份	2,900	88,160.00	0.33

91	601111	中国国航	9,400	88,078.00	0.33
92	600096	云天化	2,600	86,866.00	0.33
93	600029	南方航空	10,800	86,508.00	0.33
94	603986	兆易创新	400	85,700.00	0.32
95	002812	恩捷股份	1,500	84,960.00	0.32
96	600886	国投电力	6,400	83,968.00	0.32
97	600372	中航机载	6,200	83,204.00	0.31
98	002273	水晶光电	3,300	82,896.00	0.31
99	000878	云南铜业	4,000	82,040.00	0.31
100	688012	中微公司	300	81,816.00	0.31
101	601117	中国化学	10,500	79,065.00	0.30
102	601319	中国人保	8,800	78,760.00	0.30
103	003816	中国广核	20,800	78,208.00	0.29
104	600352	浙江龙盛	7,300	77,818.00	0.29
105	600141	兴发集团	2,200	76,076.00	0.29
106	601233	桐昆股份	4,400	75,724.00	0.28
107	600588	用友网络	5,700	75,582.00	0.28
108	601872	招商轮船	8,400	75,432.00	0.28
109	600497	驰宏锌锗	10,200	74,562.00	0.28
110	601919	中远海控	4,900	74,382.00	0.28
111	000423	东阿阿胶	1,500	73,620.00	0.28
112	300832	新产业	1,300	73,125.00	0.28
113	688599	天合光能	4,400	72,820.00	0.27
114	600256	广汇能源	14,800	72,816.00	0.27
115	000301	东方盛虹	6,600	71,874.00	0.27
116	600031	三一重工	3,400	71,842.00	0.27
117	688223	晶科能源	12,700	71,628.00	0.27
118	601618	中国中冶	24,000	71,280.00	0.27
119	600637	东方明珠	7,200	70,920.00	0.27
120	600862	中航高科	3,000	70,890.00	0.27
121	000932	华菱钢铁	12,600	70,812.00	0.27
122	600803	新奥股份	3,400	70,584.00	0.27
123	603885	吉祥航空	4,700	69,936.00	0.26
124	601607	上海医药	3,900	69,654.00	0.26
125	600332	白云山	2,700	69,498.00	0.26
126	600704	物产中大	12,300	68,511.00	0.26
127	600499	科达制造	4,900	67,963.00	0.26
128	000830	鲁西化工	4,100	67,937.00	0.26
129	600018	上港集团	12,500	67,750.00	0.25
130	601677	明泰铝业	4,500	66,555.00	0.25
131	600521	华海药业	3,900	66,183.00	0.25
132	600208	衢州发展	17,100	66,177.00	0.25
133	603568	伟明环保	2,600	65,988.00	0.25

134	600312	平高电气	3,800	65,930.00	0.25
135	002714	牧原股份	1,300	65,754.00	0.25
136	603077	和邦生物	29,000	65,540.00	0.25
137	601669	中国电建	12,600	65,520.00	0.25
138	000708	中信特钢	4,000	65,480.00	0.25
139	300558	贝达药业	1,400	65,366.00	0.25
140	603939	益丰药房	3,000	65,160.00	0.25
141	600166	福田汽车	22,300	65,116.00	0.24
142	600998	九州通	12,600	64,512.00	0.24
143	300068	南都电源	4,100	63,714.00	0.24
144	601018	宁波港	17,500	63,525.00	0.24
145	688009	中国通号	11,600	63,452.00	0.24
146	600563	法拉电子	600	62,970.00	0.24
147	600398	海澜之家	10,400	62,920.00	0.24
148	601012	隆基绿能	3,400	61,880.00	0.23
149	600039	四川路桥	6,200	61,690.00	0.23
150	600655	豫园股份	12,000	61,560.00	0.23
151	601866	中远海发	24,400	61,488.00	0.23
152	688008	澜起科技	500	58,900.00	0.22
153	300760	迈瑞医疗	300	57,135.00	0.21
154	601088	中国神华	1,400	56,700.00	0.21
155	002415	海康威视	1,800	53,712.00	0.20
156	603019	中科曙光	600	51,384.00	0.19
157	600111	北方稀土	1,100	50,732.00	0.19
158	002050	三花智控	900	49,779.00	0.19
159	002648	卫星化学	2,800	49,504.00	0.19
160	688472	阿特斯	3,300	49,203.00	0.19
161	603799	华友钴业	700	47,782.00	0.18
162	600089	特变电工	2,000	44,440.00	0.17
163	601600	中国铝业	3,400	41,548.00	0.16
164	300394	天孚通信	200	40,606.00	0.15
165	600941	中国移动	400	40,420.00	0.15
166	002230	科大讯飞	800	40,232.00	0.15
167	000792	盐湖股份	1,400	39,424.00	0.15
168	600660	福耀玻璃	600	38,862.00	0.15
169	002352	顺丰控股	1,000	38,320.00	0.14
170	601127	赛力斯	300	36,288.00	0.14
171	600183	生益科技	500	35,705.00	0.13
172	600007	中国国贸	1,800	35,676.00	0.13
173	000568	泸州老窖	300	34,866.00	0.13
174	002028	思源电气	200	30,918.00	0.12
175	000768	中航西飞	1,200	30,456.00	0.11
176	002460	赣锋锂业	400	25,156.00	0.09

177	601225	陕西煤业	1,000	21,320.00	0.08
178	002252	上海莱士	3,100	19,654.00	0.07
179	601988	中国银行	3,000	17,190.00	0.06
180	601985	中国核电	1,800	15,570.00	0.06
181	000977	浪潮信息	200	13,320.00	0.05
182	600547	山东黄金	300	11,613.00	0.04
183	000807	云铝股份	300	9,852.00	0.04
184	002466	天齐锂业	100	5,538.00	0.02
185	002709	天赐材料	100	4,633.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600919	江苏银行	18,100	188,240.00	0.71
2	605358	立昂微	2,000	69,640.00	0.26
3	601636	旗滨集团	10,600	62,858.00	0.24
4	301007	德迈仕	1,400	56,728.00	0.21
5	600335	国机汽车	8,600	55,986.00	0.21
6	300115	长盈精密	1,200	55,800.00	0.21
7	688070	纵横股份	1,000	55,400.00	0.21
8	603660	苏州科达	4,900	54,047.00	0.20
9	301106	骏成科技	1,800	53,586.00	0.20
10	600100	同方股份	6,000	53,520.00	0.20
11	605218	伟时电子	2,900	53,505.00	0.20
12	600577	精达股份	4,300	53,449.00	0.20
13	301166	优宁维	1,800	53,424.00	0.20
14	601061	中信金属	3,700	53,280.00	0.20
15	600986	浙文互联	6,800	53,176.00	0.20
16	603766	隆鑫通用	3,300	53,163.00	0.20
17	605186	健麾信息	2,700	53,055.00	0.20
18	600606	绿地控股	31,700	52,622.00	0.20
19	601588	北辰实业	30,200	52,548.00	0.20
20	600162	香江控股	28,400	52,540.00	0.20
21	603876	鼎胜新材	3,500	52,535.00	0.20
22	600331	宏达股份	4,100	52,439.00	0.20
23	600958	东方证券	4,800	52,320.00	0.20
24	002787	华源控股	4,200	52,290.00	0.20
25	301397	溯联股份	1,500	52,245.00	0.20
26	300550	和仁科技	3,600	52,236.00	0.20
27	688055	龙腾光电	14,500	52,200.00	0.20
28	301515	港通医疗	2,600	52,156.00	0.20

29	300074	华平股份	11,300	52,093.00	0.20
30	600252	中恒集团	19,000	52,060.00	0.20
31	601169	北京银行	9,500	52,060.00	0.20
32	600021	上海电力	2,600	52,052.00	0.20
33	603906	龙蟠科技	2,600	52,026.00	0.20
34	600383	金地集团	17,000	52,020.00	0.20
35	601939	建设银行	5,600	51,968.00	0.20
36	600926	杭州银行	3,400	51,952.00	0.20
37	600977	中国电影	3,300	51,876.00	0.20
38	603185	弘元绿能	1,700	51,850.00	0.20
39	600768	宁波富邦	3,700	51,800.00	0.19
40	600490	鹏欣资源	6,700	51,791.00	0.19
41	688058	宝兰德	1,900	51,737.00	0.19
42	688371	菲沃泰	2,800	51,716.00	0.19
43	000030	富奥股份	9,000	51,660.00	0.19
44	688033	天宜新材	6,700	51,590.00	0.19
45	300490	华自科技	4,300	51,557.00	0.19
46	688779	五矿新能	6,880	51,531.20	0.19
47	000709	河钢股份	22,300	51,513.00	0.19
48	688469	芯联集成	7,700	51,513.00	0.19
49	601229	上海银行	5,100	51,510.00	0.19
50	600543	莫高股份	9,700	51,507.00	0.19
51	688655	迅捷兴	3,000	51,390.00	0.19
52	600884	杉杉股份	3,800	51,338.00	0.19
53	688512	慧智微	4,600	51,336.00	0.19
54	601126	四方股份	1,700	51,136.00	0.19
55	002759	天际股份	1,100	51,073.00	0.19
56	688391	钜泉科技	1,800	50,994.00	0.19
57	600750	江中药业	2,200	50,974.00	0.19
58	688530	欧莱新材	3,100	50,964.00	0.19
59	601118	海南橡胶	8,700	50,895.00	0.19
60	603978	深圳新星	1,800	50,832.00	0.19
61	600078	澄星股份	5,300	50,827.00	0.19
62	301503	智迪科技	1,400	50,484.00	0.19
63	688556	高测股份	4,400	50,248.00	0.19
64	688148	芳源股份	5,600	49,112.00	0.18
65	688216	气派科技	2,200	49,016.00	0.18
66	601336	新华保险	700	48,790.00	0.18
67	688189	南新制药	6,100	48,617.00	0.18
68	688091	上海谊众	1,000	47,000.00	0.18
69	688449	联芸科技	1,000	45,180.00	0.17
70	688246	嘉和美康	1,100	25,575.00	0.10
71	601138	工业富联	400	24,820.00	0.09

72	600027	华电国际	4,100	20,336.00	0.08
73	688185	康希诺	320	20,112.00	0.08
74	301359	东南电子	900	17,208.00	0.06

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,843,237.00	21.98
2	300750	宁德时代	5,793,741.00	21.79
3	688256	寒武纪	3,736,491.27	14.05
4	601318	中国平安	3,732,205.00	14.04
5	600036	招商银行	3,409,991.00	12.83
6	601166	兴业银行	3,157,591.00	11.88
7	601899	紫金矿业	2,755,946.00	10.37
8	000333	美的集团	2,632,206.00	9.90
9	600900	长江电力	2,590,453.00	9.74
10	300059	东方财富	2,559,593.00	9.63
11	600276	恒瑞医药	2,108,320.00	7.93
12	300308	中际旭创	2,061,500.00	7.75
13	603259	药明康德	2,017,266.00	7.59
14	688981	中芯国际	1,804,592.32	6.79
15	002475	立讯精密	1,796,657.00	6.76
16	000651	格力电器	1,754,286.00	6.60
17	688041	海光信息	1,751,739.34	6.59
18	601328	交通银行	1,706,383.00	6.42
19	002594	比亚迪	1,660,836.00	6.25
20	601398	工商银行	1,631,534.00	6.14
21	600030	中信证券	1,544,413.00	5.81
22	600887	伊利股份	1,495,453.00	5.63
23	600150	中国船舶	1,470,884.49	5.53
24	600919	江苏银行	1,467,787.00	5.52
25	600089	特变电工	1,397,290.00	5.26
26	601668	中国建筑	1,385,784.00	5.21
27	600111	北方稀土	1,298,208.00	4.88
28	000858	五粮液	1,293,089.00	4.86
29	300274	阳光电源	1,270,605.00	4.78
30	601816	京沪高铁	1,242,454.00	4.67
31	000063	中兴通讯	1,227,712.00	4.62
32	601288	农业银行	1,223,655.00	4.60
33	601601	中国太保	1,220,818.00	4.59
34	002241	歌尔股份	1,191,421.00	4.48

35	000725	京东方 A	1,179,246.00	4.44
36	300014	亿纬锂能	1,168,630.00	4.40
37	600690	海尔智家	1,163,531.00	4.38
38	600660	福耀玻璃	1,125,480.00	4.23
39	601857	中国石油	1,124,946.00	4.23
40	603993	洛阳钼业	1,118,055.00	4.21
41	000988	华工科技	1,111,120.00	4.18
42	002714	牧原股份	1,073,676.00	4.04
43	002027	分众传媒	1,066,125.00	4.01
44	600031	三一重工	1,065,916.00	4.01
45	300476	胜宏科技	1,063,456.00	4.00
46	601728	中国电信	1,058,051.00	3.98
47	603019	中科曙光	1,038,123.00	3.90
48	000001	平安银行	1,036,422.00	3.90
49	600415	小商品城	1,033,584.00	3.89
50	601628	中国人寿	1,028,192.00	3.87
51	601988	中国银行	1,024,173.00	3.85
52	600406	国电南瑞	1,024,173.00	3.85
53	600760	中航沈飞	1,014,061.00	3.81
54	603979	金诚信	999,033.00	3.76
55	603939	益丰药房	987,305.00	3.71
56	002463	沪电股份	984,207.00	3.70
57	601225	陕西煤业	974,070.00	3.66
58	601012	隆基绿能	962,849.00	3.62
59	601919	中远海控	955,425.00	3.59
60	600028	中国石化	953,234.00	3.59
61	000338	潍柴动力	951,172.00	3.58
62	600547	山东黄金	928,472.00	3.49
63	600941	中国移动	926,567.00	3.49
64	000425	徐工机械	918,921.00	3.46
65	002236	大华股份	907,795.00	3.41
66	600188	兖矿能源	905,448.00	3.41
67	000069	华侨城 A	900,300.00	3.39
68	002001	新和成	892,198.00	3.36
69	000960	锡业股份	878,649.00	3.31
70	300124	汇川技术	875,781.00	3.29
71	600418	江淮汽车	866,699.00	3.26
72	601689	拓普集团	865,223.40	3.25
73	600905	三峡能源	859,798.00	3.23
74	000100	TCL 科技	856,319.00	3.22
75	688126	沪硅产业	855,932.32	3.22
76	601006	大秦铁路	854,271.00	3.21
77	600104	上汽集团	849,995.00	3.20

78	000938	紫光股份	848,295.00	3.19
79	002371	北方华创	847,530.00	3.19
80	600115	中国东航	841,801.00	3.17
81	002625	光启技术	835,452.00	3.14
82	688271	联影医疗	831,133.50	3.13
83	601618	中国中冶	811,413.00	3.05
84	601766	中国中车	807,132.00	3.04
85	601658	邮储银行	802,443.00	3.02
86	600183	生益科技	798,340.00	3.00
87	601088	中国神华	796,328.00	3.00
88	603799	华友钴业	792,575.00	2.98
89	603986	兆易创新	781,335.00	2.94
90	600487	亨通光电	779,740.00	2.93
91	601985	中国核电	775,583.00	2.92
92	002252	上海莱士	771,710.00	2.90
93	601058	赛轮轮胎	763,814.00	2.87
94	000932	华菱钢铁	760,202.00	2.86
95	600938	中国海油	752,212.00	2.83
96	601600	中国铝业	737,594.00	2.77
97	600011	华能国际	736,209.00	2.77
98	601155	新城控股	732,109.00	2.75
99	601888	中国中免	730,977.00	2.75
100	601233	桐昆股份	730,669.00	2.75
101	688008	澜起科技	723,925.82	2.72
102	603659	璞泰来	718,667.00	2.70
103	002128	电投能源	715,129.00	2.69
104	000807	云铝股份	713,016.00	2.68
105	600196	复星医药	712,869.00	2.68
106	002244	滨江集团	712,549.00	2.68
107	002384	东山精密	704,035.00	2.65
108	601360	三六零	697,430.00	2.62
109	600048	保利发展	694,364.00	2.61
110	603087	甘李药业	684,254.00	2.57
111	000630	铜陵有色	683,675.00	2.57
112	300408	三环集团	678,568.00	2.55
113	601677	明泰铝业	674,380.00	2.54
114	600019	宝钢股份	673,823.00	2.53
115	601989	中国重工	671,827.00	2.53
116	600489	中金黄金	671,256.00	2.52
117	002353	杰瑞股份	671,005.00	2.52
118	300760	迈瑞医疗	669,071.00	2.52
119	600352	浙江龙盛	664,053.00	2.50
120	600153	建发股份	663,315.00	2.50

121	600160	巨化股份	659,082.00	2.48
122	000408	藏格矿业	652,194.00	2.45
123	001979	招商蛇口	649,991.00	2.44
124	600521	华海药业	648,455.00	2.44
125	600009	上海机场	646,652.00	2.43
126	601939	建设银行	644,975.00	2.43
127	601390	中国中铁	640,649.00	2.41
128	601615	明阳智能	632,929.00	2.38
129	600563	法拉电子	628,834.00	2.37
130	603501	豪威集团	625,757.00	2.35
131	000538	云南白药	623,803.00	2.35
132	600516	方大炭素	623,755.00	2.35
133	002179	中航光电	621,402.00	2.34
134	601000	唐山港	616,886.00	2.32
135	600754	锦江酒店	613,008.00	2.31
136	000768	中航西飞	607,090.00	2.28
137	601877	正泰电器	606,706.00	2.28
138	000623	吉林敖东	605,244.00	2.28
139	600867	通化东宝	598,275.00	2.25
140	601633	长城汽车	595,943.00	2.24
141	000738	航发控制	595,575.00	2.24
142	605499	东鹏饮料	595,502.00	2.24
143	000792	盐湖股份	588,998.00	2.22
144	603288	海天味业	580,583.00	2.18
145	601872	招商轮船	580,481.00	2.18
146	300496	中科创达	575,045.00	2.16
147	600893	航发动力	574,183.00	2.16
148	601127	赛力斯	573,535.00	2.16
149	600008	首创环保	572,405.00	2.15
150	002138	顺络电子	565,461.00	2.13
151	600426	华鲁恒升	564,984.00	2.13
152	002273	水晶光电	559,629.00	2.11
153	002405	四维图新	557,596.00	2.10
154	600309	万华化学	555,095.00	2.09
155	601567	三星医疗	554,258.00	2.08
156	688012	中微公司	551,620.42	2.07
157	600862	中航高科	548,595.00	2.06
158	000426	兴业银锡	547,976.00	2.06
159	002352	顺丰控股	547,122.00	2.06
160	600795	国电电力	546,442.00	2.06
161	600256	广汇能源	545,729.00	2.05
162	600989	宝丰能源	544,909.00	2.05
163	688655	迅捷兴	540,207.92	2.03

164	300207	欣旺达	536,488.00	2.02
165	600176	中国巨石	536,283.00	2.02
166	000708	中信特钢	535,107.00	2.01
167	600131	国网信通	535,049.00	2.01
168	002415	海康威视	533,424.00	2.01
169	002145	钛能化学	532,537.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	5,851,746.00	22.01
2	600519	贵州茅台	5,242,835.00	19.72
3	688256	寒武纪	4,279,969.60	16.10
4	601318	中国平安	3,222,469.00	12.12
5	601899	紫金矿业	2,844,676.00	10.70
6	600036	招商银行	2,817,923.50	10.60
7	601166	兴业银行	2,614,272.00	9.83
8	300308	中际旭创	2,459,581.00	9.25
9	000333	美的集团	2,413,687.00	9.08
10	300059	东方财富	2,351,928.00	8.85
11	600900	长江电力	2,233,445.00	8.40
12	603259	药明康德	2,038,506.00	7.67
13	600276	恒瑞医药	2,033,279.00	7.65
14	002475	立讯精密	1,892,970.00	7.12
15	688041	海光信息	1,839,956.46	6.92
16	688981	中芯国际	1,773,161.10	6.67
17	002594	比亚迪	1,449,248.00	5.45
18	600111	北方稀土	1,448,574.00	5.45
19	600089	特变电工	1,441,276.00	5.42
20	601398	工商银行	1,409,372.00	5.30
21	000651	格力电器	1,407,749.00	5.30
22	600030	中信证券	1,395,382.00	5.25
23	601328	交通银行	1,378,508.00	5.19
24	300274	阳光电源	1,374,896.78	5.17
25	600150	中国船舶	1,321,150.00	4.97
26	600887	伊利股份	1,297,646.00	4.88
27	601668	中国建筑	1,208,169.00	4.54
28	603993	洛阳钼业	1,198,647.00	4.51
29	600919	江苏银行	1,183,056.00	4.45
30	600660	福耀玻璃	1,176,049.00	4.42
31	000063	中兴通讯	1,168,615.00	4.40
32	601288	农业银行	1,168,584.00	4.40

33	000858	五 粮 液	1,134,963.00	4.27
34	002714	牧原股份	1,133,569.00	4.26
35	300476	胜宏科技	1,129,396.00	4.25
36	002241	歌尔股份	1,115,698.00	4.20
37	300014	亿纬锂能	1,095,067.00	4.12
38	601601	中国太保	1,075,720.00	4.05
39	603019	中科曙光	1,073,173.00	4.04
40	600031	三一重工	1,064,188.00	4.00
41	603979	金诚信	1,063,036.00	4.00
42	600415	小商品城	1,062,603.00	4.00
43	600690	海尔智家	1,057,477.00	3.98
44	000725	京东方 A	1,017,808.00	3.83
45	601816	京沪高铁	1,015,727.00	3.82
46	600760	中航沈飞	1,003,781.00	3.78
47	000988	华工科技	996,413.00	3.75
48	601988	中国银行	991,176.00	3.73
49	601857	中国石油	987,431.00	3.71
50	601225	陕西煤业	970,913.00	3.65
51	002027	分众传媒	961,618.00	3.62
52	601689	拓普集团	959,311.40	3.61
53	601012	隆基绿能	956,157.00	3.60
54	600183	生益科技	948,084.00	3.57
55	600188	兖矿能源	938,723.00	3.53
56	601628	中国人寿	930,690.00	3.50
57	000960	锡业股份	919,434.00	3.46
58	603939	益丰药房	914,337.00	3.44
59	002463	沪电股份	906,736.00	3.41
60	000069	华侨城 A	899,854.00	3.38
61	600406	国电南瑞	899,249.00	3.38
62	002236	大华股份	899,042.00	3.38
63	000001	平安银行	890,713.00	3.35
64	600547	山东黄金	888,546.00	3.34
65	688126	沪硅产业	885,614.73	3.33
66	600941	中国移动	878,850.00	3.31
67	600487	亨通光电	878,095.00	3.30
68	601919	中远海控	863,087.00	3.25
69	601728	中国电信	861,149.00	3.24
70	300124	汇川技术	851,569.00	3.20
71	688271	联影医疗	847,722.97	3.19
72	603799	华友钴业	838,221.00	3.15
73	000938	紫光股份	833,864.00	3.14
74	000338	潍柴动力	826,390.00	3.11
75	002001	新 和 成	825,460.00	3.10

76	603986	兆易创新	825,053.00	3.10
77	000425	徐工机械	824,362.00	3.10
78	600028	中国石化	823,298.00	3.10
79	002371	北方华创	811,084.90	3.05
80	603659	璞泰来	807,656.00	3.04
81	600115	中国东航	803,804.00	3.02
82	600418	江淮汽车	799,337.00	3.01
83	300408	三环集团	798,071.00	3.00
84	601600	中国铝业	774,858.00	2.91
85	000630	铜陵有色	770,397.00	2.90
86	601618	中国中冶	770,245.00	2.90
87	000807	云铝股份	761,112.00	2.86
88	601088	中国神华	761,083.00	2.86
89	600104	上汽集团	756,380.00	2.85
90	002128	电投能源	756,168.00	2.84
91	688008	澜起科技	748,549.38	2.82
92	601985	中国核电	746,650.00	2.81
93	601155	新城控股	743,102.00	2.80
94	002252	上海莱士	742,786.00	2.79
95	600905	三峡能源	742,780.00	2.79
96	000100	TCL 科技	729,137.00	2.74
97	601058	赛轮轮胎	722,736.00	2.72
98	601360	三六零	716,649.00	2.70
99	000932	华菱钢铁	711,799.00	2.68
100	002625	光启技术	710,250.00	2.67
101	002244	滨江集团	707,503.00	2.66
102	603087	甘李药业	701,947.00	2.64
103	002353	杰瑞股份	698,781.00	2.63
104	601766	中国中车	695,162.00	2.61
105	601006	大秦铁路	694,732.00	2.61
106	600489	中金黄金	691,543.00	2.60
107	600196	复星医药	690,645.00	2.60
108	600160	巨化股份	682,769.00	2.57
109	601658	邮储银行	681,868.00	2.56
110	601615	明阳智能	680,998.00	2.56
111	601233	桐昆股份	672,865.00	2.53
112	600011	华能国际	667,804.00	2.51
113	001979	招商蛇口	660,889.00	2.49
114	600153	建发股份	655,545.00	2.47
115	000408	藏格矿业	649,734.00	2.44
116	601677	明泰铝业	644,976.00	2.43
117	600516	方大炭素	643,186.47	2.42
118	600938	中国海油	642,197.00	2.42

119	600009	上海机场	641,495.00	2.41
120	300496	中科创达	638,515.00	2.40
121	601877	正泰电器	636,400.00	2.39
122	300760	迈瑞医疗	628,224.00	2.36
123	600754	锦江酒店	627,944.00	2.36
124	600521	华海药业	626,648.00	2.36
125	601888	中国中免	625,536.00	2.35
126	000538	云南白药	621,544.00	2.34
127	000623	吉林敖东	620,805.00	2.34
128	002138	顺络电子	619,219.00	2.33
129	601633	长城汽车	613,455.00	2.31
130	601000	唐山港	612,686.00	2.30
131	002384	东山精密	605,961.00	2.28
132	605499	东鹏饮料	597,976.00	2.25
133	600867	通化东宝	597,078.00	2.25
134	601872	招商轮船	586,017.00	2.20
135	600362	江西铜业	585,236.00	2.20
136	600008	首创环保	582,671.00	2.19
137	002405	四维图新	582,275.00	2.19
138	600352	浙江龙盛	581,989.00	2.19
139	601939	建设银行	580,084.00	2.18
140	002273	水晶光电	579,728.00	2.18
141	601567	三星医疗	575,291.00	2.16
142	000738	航发控制	575,070.00	2.16
143	600893	航发动力	571,326.00	2.15
144	000426	兴业银锡	567,831.00	2.14
145	603288	海天味业	565,459.00	2.13
146	000768	中航西飞	564,760.00	2.12
147	002532	天山铝业	563,915.00	2.12
148	600019	宝钢股份	562,745.00	2.12
149	600048	保利发展	557,408.00	2.10
150	600741	华域汽车	555,557.00	2.09
151	601127	赛力斯	552,720.00	2.08
152	000792	盐湖股份	551,195.00	2.07
153	600563	法拉电子	547,417.00	2.06
154	002145	钛能化学	545,272.00	2.05
155	600353	旭光电子	544,083.00	2.05
156	688012	中微公司	541,651.10	2.04
157	600718	东软集团	541,359.00	2.04
158	600176	中国巨石	541,336.00	2.04
159	600909	华安证券	536,873.00	2.02
160	600745	闻泰科技	535,677.00	2.01
161	601390	中国中铁	535,072.00	2.01

162	601168	西部矿业	533,926.00	2.01
-----	--------	------	------------	------

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	293,814,309.56
卖出股票收入（成交）总额	280,798,589.42

#### 8.5 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	-	-
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)	15,700.25	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,700.25	0.06

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

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	113699	金 25 转债	90	15,700.25	0.06

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

无余额。

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

无余额。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、深圳市交通运输局的处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现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、处罚的情形。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,763.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,763.15

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无余额。

### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投中证 A500 指数增强 A	180	47,120.79	0.00	0.0000%	8,481,742.47	100.0000%
中信建投中证 A500 指数增强 C	407	37,453.87	0.00	0.0000%	15,243,726.53	100.0000%
合计	578	41,047.52	0.00	0.0000%	23,725,469.00	100.0000%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投中证 A500 指数增强 A	48,626.04	0.5733%
	中信建投中证 A500 指数增强 C	10.00	0.0001%
	合计	48,636.04	0.2050%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中信建投中证 A500 指数增强 A	0
	中信建投中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投中证 A500 指数增强 A	0~10
	中信建投中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证 A500 指数增强 A	中信建投中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 06 月 30 日）基金份额总额	54,468,430.15	181,276,010.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,078,658.48	3,885,568.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	53,065,346.16	169,917,852.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,481,742.47	15,243,726.53

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 15,000.00 元整，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金融街证券股份有限公司	3	437,567,637.70	76.30%	84,244.94	76.32%	-
中信建投证券股份有限公司	3	135,901,540.30	23.70%	26,140.91	23.68%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

#### （1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

#### （2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	规定网站、规定报刊	2025-07-01
2	中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	规定网站、规定报刊	2025-07-31
3	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-10-28
4	中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	规定网站	2025-10-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日