

中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金  
2026 年第 1 季度报告

2026 年 03 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:华夏银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 04 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年04月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

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03月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 中信建投上证科创板综合指数增强  |
| 基金主代码      | 024390   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2025 年 06 月 24 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 29,315,770.18 份  |
| 投资目标       | 本基金为指数增强型基金，在力求对上证科创板综合指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法精选个股，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       | 本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，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。<br>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。 |
| 业绩比较基准     | 上证科创板综合指数收益率×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。   |

|                 |   |                   |
|-----------------|---|-------------------|
|                 | 本基金如投资港股通标的股票，需承担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。 |                   |
| 基金管理人           | 中信建投基金管理有限公司  |                   |
| 基金托管人           | 华夏银行股份有限公司  |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 中信建投上证科创板综合指数增强 A                                       | 中信建投上证科创板综合指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 024390  | 024391            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,587,315.92 份  | 23,728,454.26 份   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 03 月 31 日） |                   |
|-----------------|--|-------------------|
|                 | 中信建投上证科创板综合指数增强 A                      | 中信建投上证科创板综合指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益      | 545,088.57                             | 2,522,282.42      |
| 2. 本期利润         | -57,950.40                             | -48,391.65        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0107                                | -0.0019           |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,377,932.34                           | 27,002,956.13     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1415                                 | 1.1380            |

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、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

###### 中信建投上证科创板综合指数增强 A 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | -2.44%     | 1.80%         | -0.98%         | 1.92%                 | -1.46%  | -0.12% |
| 过去六个月          | -6.72%     | 1.59%         | -5.33%         | 1.73%                 | -1.39%  | -0.14% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 14.15%     | 1.49%         | 30.07%         | 1.70%                 | -15.92% | -0.21% |

###### 中信建投上证科创板综合指数增强 C 净值表现

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

|            | ①      | 标准差②  | 准收益率③  | 准收益率标准差④ |         |        |
|------------|--------|-------|--------|----------|---------|--------|
| 过去三个月      | -2.54% | 1.80% | -0.98% | 1.92%    | -1.56%  | -0.12% |
| 过去六个月      | -6.90% | 1.59% | -5.33% | 1.73%    | -1.57%  | -0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.80% | 1.49% | 30.07% | 1.70%    | -16.27% | -0.21% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中信建投上证科创板综合指数增强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



中信建投上证科创板综合指数增强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



注：1、本基金于 2025 年 06 月 24 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                    | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---------------------------------------|-------------|------|--------|--|
|     |                                       | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 杨志武 | 本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人、兼任指数与量化投资部行政负责人 | 2025-06-24  | -    | 14 年   | 中国籍，伯明翰大学货币银行与金融学硕士。曾任职于北京首创期货有限责任公司期权及场外衍生品部从事衍生品投资与研究，中国国际期货股份有限公司金融业务部从事衍生品投资与研究，中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部从事证券投资研究、权益投资部担任投资经理。2022 年 3 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部行政负责人，兼任指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。 |
| 艾翀  | 本基金的基金经理                              | 2025-06-24  | -    | 9 年    | 中国籍，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师，国金基金管理有限公司指数投资部、量化投资  |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金销售有限公司基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿保险有限公司投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

注：1、基金经理任职日期、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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

### 4.3.1 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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年作为“十五五”的开局之年，一季度 GDP 增长稳健向好，预计增速 4.8%到 5.3%之间。强劲的出口、基建投资高增长和 AI 投资对各行业的持续增强的影响是一季度的主要特征。分月度来看，1-2 月经济剔除季节性影响后，表现强于历史同期；3 月 PMI 产需两端同步回升，重回荣枯线以上；而 3 月 PPI 从 2022 年 10 月转负以来首次同比转正，预期企业盈利改善，后续财政收入也会相应改善。一季度的进出口规模实现了人类历史的新突破，达到 11.84 万亿。出口的地域结构和产品结构跟 2025 年类似。整体地产销售仍然处于弱复苏阶段，但是城市之间出现了显著分化，京沪二手房市场出现“小阳春”。地产开发投资降速大幅收窄。内需的稳定增长为经济提供了支撑，CPI 连续两个月在 1%以上。消费的结构还是延续 2025 年的特征，以文旅为代表的服务型消费增速较快，“以旧换新”等政策支持也功不可没。

美国一季度经济增长面临下行压力，亚特兰大联储的 GDPNow 预测的一季度环比折年率从 2 月份的 3%以上回落到在 4 月 9 日的 1.3%。3 月份开始的美以伊战争，提升了油价以及通胀预期，进而也降低了美联储降息的概率，市场对滞胀和衰退的担忧都有所提升。在美国权益市场上，先是对 AI 发展的担忧造成了科技股的回撤，其后又受到战争影响进一步回调。随着战争重新进入谈判阶段，各类风险资产的波动率显著降低，加上大型金融机构和科技股的业绩表现仍然表现优异，盈利增速进一步加速，以科技股为代表的高弹性公司率先反弹。

全 A 今年的春季躁动节奏提前，1 月快速上行以后，2 月进入震荡，3 月资金止盈离场同时受到战争风险催化出现明显回撤。全季度呈现过山车行情。四月进入反弹行情以后，创业板领涨。而十年国债活跃券的利率呈震荡下行走势，从 1.85%降到 1.811%。

展望 2026 年二季度，国内经济基本面可能能够延续一季度的偏强走势，一方面受到内生经济增长的支撑，另一方面外需的支撑持续存在甚至受到战争影响进一步强化。美欧日的经济可能有受到战争影响进入滞涨的风险，美联储控制的全球流动性也可能难以再宽松。但是国内 PPI 增速回正，可能会使得企业盈利、财政收入、居民收入和消费均逐步进入正向循环；中国制造业的产业链优势可能进一步稳固进出口；而在人民币强势的时段，流动性方面至少不会收紧。随着战争冲击的结束和时间上接近美国中期选举，中国可能会有更加稳定的外部环境。仍然判断权益可能继续从战争的冲击中修复，以震荡上行为主，如果基本面超预期，也不排除创新高的机会。有政策支持和有业绩支撑的新兴产业、以及受益于反内卷的偏上游行业、新型消费和服务型消费等，在二季度可能会有更好的表现。同时仍然需要注意市场节奏，关注基本面不及预期和外部冲击的风险。

报告期内依然坚持价值投资的理念，在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，在控制跟踪误差的基础上，利用量化方法对各种风格与行业进行了均衡的配置，充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争在行业与风格均衡配置的基础上，追求组合长期相对稳健的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投上证科创板综合指数增强 A 基金份额净值为 1.1415 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.44%，同期业绩比较基准收益率为-0.98%；截至报告期末中信建投上证科创板综合指数增强 C 基金份额净值为 1.1380 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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 2026 年 2 月 9 日起出现连续六十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万的情形。基金管理人已向中国证监会报送了相关解决方案的报告。自 2026 年 2 月 10 日起，本基金的审计费、信息披露费等相关固定费用由基金管理人固有资金承担。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 31,376,818.08 | 93.57         |
|    | 其中：股票             | 31,376,818.08 | 93.57         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,523,793.81  | 4.54          |
|    | 其中：债券             | 1,523,793.81  | 4.54          |
|    | 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      | 536,136.52    | 1.60          |
| 8  | 其他资产              | 96,243.70     | 0.29          |
| 9  | 合计                | 33,532,992.11 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过深港通机制投资香港股票的公允价值为 192,228.80 元，占基金资产净值比例为 0.58%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 23,906,159.28 | 71.62         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| 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 | 4,262,368.00  | 12.77 |
| 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      | 946,771.00    | 2.84  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 8,960.00      | 0.03  |
| 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              | 29,124,258.28 | 87.25 |

### 5.2.2 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         | 5,394.00     | 0.02          |
| B  | 采矿业              | 89,028.00    | 0.27          |
| C  | 制造业              | 1,402,048.00 | 4.20          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 157,402.00   | 0.47          |
| E  | 建筑业              | 12,884.00    | 0.04          |
| F  | 批发和零售业           | 41,151.00    | 0.12          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 52,204.00    | 0.16          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,415.00    | 0.10          |
| J  | 金融业              | 122,965.00   | 0.37          |
| K  | 房地产业             | 12,078.00    | 0.04          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 24,353.00    | 0.07          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,230.00    | 0.04          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 62,106.00    | 0.19          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -             |
| P  | 教育               | -            | -             |
| Q  | 卫生和社会工作          | 8,590.00     | 0.03          |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 19,453.00    | 0.06          |
| S  | 综合               | 3,030.00     | 0.01          |
|    | 合计               | 2,060,331.00 | 6.17          |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----------|-----------|---------------|
| 非日常生活消费品 | 42,028.42 | 0.13          |
| 日常消费品    | 9,154.43  | 0.03          |
| 金融       | 3,377.28  | 0.01          |

|      |            |      |
|------|------------|------|
| 医疗保健 | 58,178.45  | 0.17 |
| 信息技术 | 36,755.44  | 0.11 |
| 通讯业务 | 42,734.78  | 0.13 |
| 合计   | 192,228.80 | 0.58 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 688041 | 海光信息 | 6,500  | 1,366,690.00 | 4.09         |
| 2  | 688012 | 中微公司 | 4,100  | 1,256,158.00 | 3.76         |
| 3  | 688981 | 中芯国际 | 12,400 | 1,166,220.00 | 3.49         |
| 4  | 688256 | 寒武纪  | 622    | 611,426.00   | 1.83         |
| 5  | 688008 | 澜起科技 | 4,700  | 588,816.00   | 1.76         |
| 6  | 688396 | 华润微  | 12,700 | 565,658.00   | 1.69         |
| 7  | 688036 | 传音控股 | 9,300  | 510,105.00   | 1.53         |
| 8  | 688002 | 睿创微纳 | 4,500  | 455,400.00   | 1.36         |
| 9  | 688009 | 中国通号 | 75,500 | 428,840.00   | 1.28         |
| 10 | 688187 | 时代电气 | 7,800  | 405,210.00   | 1.21         |

#### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量(股)  | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------|-----------|--------------|
| 1  | 601998 | 中信银行   | 10,000 | 83,000.00 | 0.25         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股   | 100    | 42,734.78 | 0.13         |
| 3  | 09988  | 阿里巴巴-W | 400    | 42,028.42 | 0.13         |
| 4  | 02359  | 药明康德   | 300    | 31,123.99 | 0.09         |
| 4  | 603259 | 药明康德   | 100    | 9,810.00  | 0.03         |
| 5  | 600750 | 华润江中   | 1,500  | 40,080.00 | 0.12         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 1,514,264.38 | 4.54         |
| 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） | 9,529.43     | 0.03 |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 1,523,793.81 | 4.56 |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019785 | 25 国债 13 | 15,000 | 1,514,264.38 | 4.54         |
| 2  | 118067 | 上 26 转债  | 70     | 7,000.43     | 0.02         |
| 3  | 127113 | 长高转债     | 18     | 2,529.00     | 0.01         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人根据风险管理的原则，以套期保值为目的，综合考虑流动性、基差水平等因素，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，综合考虑流动性、基差水平等因素，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国铁路通信信号股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到丽水市交通运输局的处罚。

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 96,243.70 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 96,243.70 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           | 中信建投上证科创板综合指数增强 A | 中信建投上证科创板综合指数增强 C |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 5,775,062.42      | 31,907,590.31     |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,591,917.71      | 5,451,886.17      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,779,664.21      | 13,631,022.22     |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                 | -                 |
| 报告期期末基金份额总额               | 5,587,315.92      | 23,728,454.26     |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投上证科创板综合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。

## 9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

## 9.3 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  
二〇二六年四月二十二日