

光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	8
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	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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的情况	55
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.8 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	56
10.9 其他重大事件	58
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	光大保德信中证 500 指数增强	
基金主代码	013639	
交易代码	013639	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	122,033,481.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	013639	013640
报告期末下属分级基金的份额总额	72,506,713.51 份	49,526,768.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的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 7.75%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。 1、股票（含存托凭证）投资策略 （1）指数化投资策略 本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。 （2）指数增强投资策略 本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。 1) 多因子选股模型 本基金根据国内资本市场的实际运行情况和大量历史数据的实证检验，结合本基金管理人量化团队多年的研究与投资经验，充分挖掘并精选各种有效因子，构建多因子选股模型。本基金将使用多因子选股模型对全市场股票进行评分，仔细分析个股在各个因子的得分情况，择优精选出基本面优

	秀、成长性好、符合市场热点、主题投资或者行业轮动特点等具有良好预期收益的个股，构建投资组合并根据市场变化趋势，持续改进模型的有效性，力争基金资产长期稳健增值。 本基金考察的因子包括成长因子、估值因子、基本面因子和流动性因子。 ①成长因子 本基金考察的成长因子可以参考以下指标：PEG、营业收入增长率、过去三年的每年净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率（留存收益率*净资产收益率）等； ②估值因子 本基金考察的估值因子可以参考以下指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）等； ③基本面因子 本基金考察的基本面因子可以参考以下指标：总资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）、销售毛利率、主营业务收入、资产负债率、每股收益、每股现金流等； ④流动性因子 本基金考察的流动性因子可以参考以下指标：成交量、换手率、流通市值等。本基金将依据经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，采用定量的模式挑选最稳定有效的因子集合作为选股模型的判别因子，并依据投资目标，权衡风险与收益特征，构建定量选股模型。模型的使用以及因子的判定方法同样需要随着市场的变化根据不同的测试环境以及不同的测试结果进行动态的更新。 2）风险估测模型与交易成本模型 本基金运用风险估测模型对投资组合风险进行监控与评估，力争控制投资组合风险在预算范围内。此外，本基金所采用的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以控制交易成本、减少交易对业绩带来的负面影响。 3）投资组合优化模型 本基金将综合考虑股票预期超额收益、风险水平、交易成本、流动性等因素进行投资组合优化，其中选股范围以成份股及备选成份股为主，同时包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票等。 （3）本基金还将关注互联互通机制下港股市场投资机会，包括： 1）香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面； 2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。 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或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。 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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。 2、债券投资策略
--	--

	本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。 3、证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。 4、资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。 5、衍生品投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、股票期权等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。 本基金在进行股指期货投资时，将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。 若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 7、其他品种投资策略 法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。
--	---

业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见本招募说明书“风险揭示”部分。

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		光大保德信基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	周直毅
	联系电话	(021) 80262888	021-68475608
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		4008-202-888	95594
传真		(021) 80262468	021-68476901
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层	上海市黄浦区中山南路688号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号37层
邮政编码		200010	200120
法定代表人		高瑞东	顾建忠

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告置备地点	光大保德信基金管理有限公司、上海银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	23,327,830.83	14,187,637.16
本期利润	18,757,602.51	10,602,019.62
加权平均基金份额本期利润	0.2261	0.2002
本期加权平均净值利润率	16.95%	15.26%
本期基金份额净值增长率	17.59%	17.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	31,203,297.54	19,890,725.57
期末可供分配基金份额利润	0.4304	0.4016
期末基金资产净值	103,710,011.05	69,417,493.58
期末基金份额净值	1.4304	1.4016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	43.04%	40.16%

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）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

光大保德信中证 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	14.94%	1.48%	17.61%	1.56%	-2.67%	-0.08%
过去六个月	17.59%	1.49%	19.93%	1.58%	-2.34%	-0.09%

过去一年	43.79%	1.25%	49.68%	1.35%	-5.89%	-0.10%
过去三年	58.34%	1.25%	48.15%	1.41%	10.19%	-0.16%
自基金合同生效起至今	43.04%	1.18%	24.79%	1.31%	18.25%	-0.13%

光大保德信中证 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	14.81%	1.48%	17.61%	1.56%	-2.80%	-0.08%
过去六个月	17.34%	1.49%	19.93%	1.58%	-2.59%	-0.09%
过去一年	43.14%	1.25%	49.68%	1.35%	-6.54%	-0.10%
过去三年	56.29%	1.25%	48.15%	1.41%	8.14%	-0.16%
自基金合同生效起至今	40.16%	1.18%	24.79%	1.31%	15.37%	-0.13%

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

光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 9 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)

光大保德信中证 500 指数增强 A



光大保德信中证 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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55%和 45%的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2026 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 87 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金,光大保德信货币市场基金,光大保德信红利混合型证券投资基金,光大保德信新增长混合型证券投资基金,光大保德信优势配置混合型证券投资基金,光大保德信增利收益债券型证券投资基金,光大保德信均衡精选混合型证券投资基金,光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信中小盘混合型证券投资基金,光大保德信信用添益债券型证券投资基金,光大保德信行业轮动混合型证券投资基金,光大保德信现金宝货币市场基金,光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金,光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金,光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金,光大保德信耀钱包货币市场基金,光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信中国

制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信风格轮动混合型证券投资基金,光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金,光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信安和债券型证券投资基金,光大保德信安祺债券型证券投资基金,光大保德信永利纯债债券型证券投资基金,光大保德信安诚债券型证券投资基金,光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金,光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信中高等级债券型证券投资基金,光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金,光大保德信超短债债券型证券投资基金,光大保德信晟利债券型证券投资基金,光大保德信安泽债券型证券投资基金,光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信景气先锋混合型证券投资基金,光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金,光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金,光大保德信研究精选混合型证券投资基金,光大保德信消费主题股票型证券投资基金,光大保德信瑞和混合型证券投资基金,光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金,光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金,光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金,光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金,光大保德信锦弘混合型证券投资基金,光大保德信新机遇混合型证券投资基金,光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金,光大保德信品质生活混合型证券投资基金,光大保德信健康优加混合型证券投资基金,光大保德信睿盈混合型证券投资基金,光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金,光大保德信创新生活混合型证券投资基金,光大保德信恒鑫混合型证券投资基金,光大保德信纯债债券型证券投资基金,光大保德信核心资产混合型证券投资基金,光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信汇佳混合型证券投资基金,光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信高端装备混合型证券投资基金,光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金,光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金,光大保德信专精特新混合型证券投资基金,光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金,光大保德信数字经济主题混合型证券投资基金,光大保德信鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信安选平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF),光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金,光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金,光大保德信阳光三个月持有期混合型基金中基金 (FOF),光大保德信中证 A500 指数型证券投资基金,光大保德信添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信国证通用航空产业指数型发起式证券投资基金,光大保德信国证机器人产业指数型发起式证券投资基金,光大保德信阳光香港精选混合型证券投资基金 (QDII),光大保德信阳光混合型证券投资基金,光大保德信阳光启明星创新驱动主题混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳

健增长混合型证券投资基金,光大保德信阳光价值 30 个月持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光优选一年持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳债中短债债券型证券投资基金,光大保德信阳光智造混合型证券投资基金,光大保德信阳光现金宝货币市场基金,光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金,光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王卫林	基金经理	2023-08-22	-	10 年	王卫林先生,北京大学软件工程专业硕士。2016 年 7 月至 2018 年 1 月在南方基金管理有限公司任职量化研究员;2018 年 1 月至 2023 年 2 月在长城基金管理有限公司任职量化与指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理;2023 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司,现任权益管理总部量化投资团队基金经理,2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理,2025 年 7 月至今担任光大保德信中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理,2025 年 8 月至今担任光大保德信国证通用航空产业指数型发起式证券投资基金的基金经理,2025 年 9 月至今担任光大保德信国证机器人产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。
朱剑涛	权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作）、基金经理	2024-10-26	-	18 年	朱剑涛先生,2008 年毕业于复旦大学,获得理学硕士。2008 年 7 月至 2010 年 8 月在华宝信托有限责任公司任职量化研究助理;2010 年 9 月至 2015 年 3 月在海通证券股份有限公司任职金融工程高级分析师;2015 年 4 月至 2022 年 5 月在东方证券股份有限公司任职金融工程首席分析师;2022 年 6

					月至 2023 年 8 月在海南进化论私募基金管理有限公司任职量化研究负责人；2023 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队副团长（主持工作），2024 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2024 年 5 月至 2026 年 4 月担任光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至今担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至 2026 年 4 月担任光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月至今担任光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至今担任光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月至今担任光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金的基金经理，2026 年 4 月至今担任光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理，2026 年 7 月至今担任光大保德信中证科创创业人工智能指数型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，

为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有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

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。本基金与公司旗下其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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

本基金采用机器学习量化模型，选取预期收益高的个股，按产品合同要求，严控指数成分股比例，同时适度控制投资组合与基准指数的行业、风格、个股偏离度，降低跟踪误差。机器学习模型的输入数据，除了常用的选股指标，例如：估值、成长、量价等，还会借助机器算力，让模型从不同类型输入数据中去学习挖掘低相关性的选股因子，并根据市场风格变化自学习合适的因子配比权重。

2026 年上半年 A 股市场分化明显，科创 50 和创业板指领涨市场，半年度涨幅 64.3% 和 35.6%，对比之下，中证红利和万得小市值指数分别下跌 7.3% 和 8.7%。市场分化集中表现在二季度六月份，科技赛道持续领跑，传统行业面临转型压力；外需强于内需、新兴强于传统；市场成交极其活跃，数个交易日的全市场成交额突破 3.5 万亿。量化策略持仓比较分散，偏好低波和反转特征，在二季度的高波、高贝塔、高集中度、持续强动量的科技股行情中表现不佳。500 指增产品控制了中证 500 指数成分股的持仓比例，受小微盘回撤的影响相对较小。量化策略的修复需要等待市场热点集聚效应降低和整体波动率的均值回归。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金 A 份额净值增长率为 17.59%，业绩比较基准收益率为 19.93%，C 份额净值增长率为 17.34%，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

2026 年下半年，国内经济估计将延续外需强于内需，生产强于需求，新动能强于传统动能的分化特征，AI 链条、高端制造、电子等行业受益，地产链、传统制造业和居民消费将承压，AI 算力产业链仍是共识度最高的主线。市场在经历了上半场的“拔估值”后，会逐步转向那些有成长空间和业绩支撑的公司，此外，市场风格或伴随着波动更趋于均衡；需把握攻守平衡，在风格轮动中捕捉结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	16,077,750.01	15,997,779.24
结算备付金		1,401.75	1,399.94
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	158,051,212.09	178,184,086.37
其中：股票投资		158,021,211.34	178,184,086.37
基金投资		-	-
债券投资		30,000.75	-
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		791,613.64	321,709.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		174,921,977.49	194,504,974.75
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		1,378,874.09	4,055,090.92
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	137,005.98	171,119.59
应付托管费	6.4.10.2.2	20,550.90	25,667.91
应付销售服务费		22,601.35	22,099.44
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	6.4.7.6	235,440.54	194,706.43
负债合计		1,794,472.86	4,468,684.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	122,033,481.52	157,180,263.52

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	51,094,023.11	32,856,026.94
净资产合计		173,127,504.63	190,036,290.46
负债和净资产总计		174,921,977.49	194,504,974.75

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4187 元，基金份额总额 122,033,481.52 份。其中 A 类基金份额净值 1.4304 元，份额总额 72,506,713.51 份；C 类基金份额净值 1.4016 元，份额总额 49,526,768.01 份。

（2）货币资金本期末余额中包含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。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,626,817.29	23,546,376.55
1.利息收入		31,265.20	111,778.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,265.20	111,778.92
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）		38,716,225.86	22,622,121.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	37,621,492.11	17,577,959.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	39,819.87	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,054,913.88	5,044,161.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,155,845.86	709,822.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	35,172.09	102,654.03
减：二、营业总支出		1,267,195.16	3,438,119.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	896,343.94	2,557,783.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,451.53	383,667.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	138,024.54	398,289.99
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	98,375.15	98,378.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,359,622.13	20,108,257.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,359,622.13	20,108,257.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,359,622.13	20,108,257.27

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	157,180,263.52	-	32,856,026.94	190,036,290.46
二、本期期初净资产	157,180,263.52	-	32,856,026.94	190,036,290.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-35,146,782.00	-	18,237,996.17	-16,908,785.83
（一）、综合收益总额	-	-	29,359,622.13	29,359,622.13
（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）	-35,146,782.00	-	-11,121,625.96	-46,268,407.96
其中：1.基金申购款	69,757,173.79	-	23,079,995.18	92,837,168.97
2.基金赎回款	-104,903,955.79	-	-34,201,621.14	-139,105,576.93
（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	122,033,481.52	-	51,094,023.11	173,127,504.63
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	489,897,216.05	-	-26,267,794.36	463,629,421.69
二、本期期初净资产	489,897,216.05	-	-26,267,794.36	463,629,421.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	52,585,733.41	-	20,129,103.76	72,714,837.17
（一）、综合收益总额	-	-	20,108,257.27	20,108,257.27
（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）	52,585,733.41	-	20,846.49	52,606,579.90
其中：1.基金申购款	284,387,616.82	-	-10,206,646.53	274,180,970.29
2.基金赎回款	-231,801,883.41	-	10,227,493.02	-221,574,390.39
（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	542,482,949.46	-	-6,138,690.60	536,344,258.86

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：

基金管理人负责人：高瑞东，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：李勇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系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[2021]2860 号《关于准予光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 9 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 530,197,196.53 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权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。

本基金管理人根据相关法律法规可以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：本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 10%）；投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，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×95%+活期存款利率（税后）×5%

6.4.2 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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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‰;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;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,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。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定,资管产品运营过程中发生的应税交易,资

管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、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》的规定，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。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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 号文《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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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》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 号文《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。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 6 月 30 日
活期存款	5,411,231.14
等于：本金	5,410,698.00
加：应计利息	533.14
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	10,666,518.87
等于：本金	10,665,598.04
加：应计利息	920.83
合计	16,077,750.01

注：其他存款本期末余额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 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	159,409,698.12	-	158,021,211.34	-1,388,486.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所 市场	30,000.00	0.75	30,000.75	-
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	30,000.00	0.75	30,000.75	-
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		159,439,698.12	0.75	158,051,212.09	-1,388,486.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	61.49
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	-
其他应付款	21,618.90
预提审计费	29,752.78

预提信息披露费	179,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	235,440.54

6.4.7.7 实收基金

光大保德信中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	104,550,125.19	104,550,125.19
本期申购	17,190,946.27	17,190,946.27
本期赎回（以“-”号填列）	-49,234,357.95	-49,234,357.95
本期末	72,506,713.51	72,506,713.51

光大保德信中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	52,630,138.33	52,630,138.33
本期申购	52,566,227.52	52,566,227.52
本期赎回（以“-”号填列）	-55,669,597.84	-55,669,597.84
本期末	49,526,768.01	49,526,768.01

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

光大保德信中证 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	28,849,846.57	-6,229,852.70	22,619,993.87
本期期初	28,849,846.57	-6,229,852.70	22,619,993.87
本期利润	23,327,830.83	-4,570,228.32	18,757,602.51
本期基金份额交易产生的变动数	-11,788,400.32	1,614,101.48	-10,174,298.84
其中：基金申购款	7,944,405.23	-1,765,106.04	6,179,299.19

基金赎回款	-19,732,805.55	3,379,207.52	-16,353,598.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,389,277.08	-9,185,979.54	31,203,297.54

光大保德信中证 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	13,332,915.21	-3,096,882.14	10,236,033.07
本期期初	13,332,915.21	-3,096,882.14	10,236,033.07
本期利润	14,187,637.16	-3,585,617.54	10,602,019.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,456,295.36	508,968.24	-947,327.12
其中：基金申购款	20,594,423.12	-3,693,727.13	16,900,695.99
基金赎回款	-22,050,718.48	4,202,695.37	-17,848,023.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,064,257.01	-6,173,531.44	19,890,725.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,297.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,965.95
结算备付金利息收入	1.81
其他	-
合计	31,265.20

注：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产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	553,696,644.79
减：卖出股票成本总额	515,394,200.90
减：交易费用	680,951.78
买卖股票差价收入	37,621,492.11

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1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39,817.25
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	39,819.87

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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,732.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,900.00
减：应计利息总额	1.87
减：交易费用	13.15
买卖债券差价收入	39,817.25

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,054,913.88
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	1,054,913.88
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-8,155,845.86
——股票投资	-8,155,845.86
——债券投资	-
——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	-8,155,845.86

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	35,172.09
合计	35,172.09

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	115.00
账户维护费	9,000.00
合计	98,375.15

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,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露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
光大保德信基金管理有限公司（“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	896,343.94	2,557,783.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	324,687.73	586,903.94
应支付基金管理人的净管理费	571,656.21	1,970,879.65

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,451.53	383,667.55

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C	合计
光大证券	-	5,310.21	5,310.21
光大保德信	-	33,644.52	33,644.52
上海银行	-	1,313.91	1,313.91
合计	-	40,268.64	40,268.64

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信中证500 指数增强A	光大保德信中证500指数 增强C	合计
上海银行	-	603.77	603.77
光大保德信	-	250,998.48	250,998.48
光大证券	-	1,941.03	1,941.03
合计	-	253,543.28	253,543.28

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H=E \times C$ 类基金销售服务费年费率/当年天数
H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内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

无。

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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	光大保德信中证500 指数增强A	光大保德信中证500 指数增强C	光大保德信中证500 指数增强A	光大保德信中证500 指数增强C
期初持有的基金份额	9,258,673.42	-	9,258,673.42	-

额				
期间申购/买入总份 额	-	-	-	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份 额	9,258,673.42	-	9,258,673.42	-
期末持有的基金份 额 占基金总份额比例	12.77%	-	2.81%	-

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2.基金管理人投资本基金的费率标准与其他同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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

光大保德信中证 500 指数增强 A

份额单位：份

关联方名称	光大保德信中证500指数增强A本期末 2026年6月30日		光大保德信中证500指数增强A上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
光大证券	2,894,099.78	3.99%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

光大保德信中证 500 指数增强 C

份额单位：份

关联方名称	光大保德信中证500指数增强C本期末 2026年6月30日		光大保德信中证500指数增强C上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
光大保德信资管	1,456,770.34	2.94%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	5,411,231.14	13,297.44	24,589,470.92	69,133.41

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内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

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	607.00	5,748.29	42,574.98	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	267.00	5,254.56	37,777.83	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	817.00	14,313.84	29,346.64	-
00139	惠科	2026-0	6 个月	新股	10.12	27.73	876.00	8,865.	24,291	-

9	股份	6-16		流通受限				12	.48	
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	141.00	3,705.48	24,264.69	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	52.00	4,793.36	24,083.80	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	770.00	6,021.40	15,969.80	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	566.00	3,628.06	13,657.58	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	167.00	3,662.31	12,989.26	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	354.00	2,506.32	10,053.60	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	112.00	2,764.16	9,721.60	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	119.00	3,172.54	6,064.24	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	190.00	5,166.10	5,948.90	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	137.00	4,162.06	5,341.63	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	42.00	3,291.96	5,114.34	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	84.00	4,699.80	4,796.40	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	85.00	1,339.60	3,970.35	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	185.00	2,068.30	3,254.15	-

603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	41.00	1,553.08	1,429.67	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	67.00	1,231.46	1,124.26	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	33.00	1,105.17	1,119.69	-
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
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月以内	配债未上市	100.00	100.00	170.00	17,000.00	17,000.52	-
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月以内	配债未上市	100.00	100.00	130.00	13,000.00	13,000.23	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因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融出证券。

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财务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内部管理制度和流程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体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

6.4.13.2 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。本基金的活期银行存

款存放在本基金的托管人，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均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，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

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基金份额持有人可随时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。

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期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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的

可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为结算备付金、债券投资及货币资金等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30 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	16,077,750.01	-	-	-	-	-	16,077,750.01
结算备付金	1,401.75	-	-	-	-	-	1,401.75
交易性金融资产	-	-	-	-	30,000.75	158,021,211.34	158,051,212.09
应收申购款	-	-	-	-	-	791,613.64	791,613.64
资产总计	16,079,151.76	-	-	-	30,000.75	158,812,824.98	174,921,977.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,378,874.09	1,378,874.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	137,005.98	137,005.98
应付托管费	-	-	-	-	-	20,550.90	20,550.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,601.35	22,601.35
其他负债	-	-	-	-	-	235,440.54	235,440.54
负债总计	-	-	-	-	-	1,794,472.86	1,794,472.86
利率敏感度缺口	16,079,151.76	-	-	-	30,000.75	157,018,352.12	173,127,504.63
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	15,997,779.24	-	-	-	-	-	15,997,779.24
结算备付金	1,399.94	-	-	-	-	-	1,399.94

交易性金融资产	-	-	-	-	-	178,184,086.37	178,184,086.37
应收申购款	-	-	-	-	-	321,709.20	321,709.20
资产总计	15,999,179.18	-	-	-	-	178,505,795.57	194,504,974.75
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,055,090.92	4,055,090.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,119.59	171,119.59
应付托管费	-	-	-	-	-	25,667.91	25,667.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,099.44	22,099.44
其他负债	-	-	-	-	-	194,706.43	194,706.43
负债总计	-	-	-	-	-	4,468,684.29	4,468,684.29
利率敏感度缺口	15,999,179.18	-	-	-	-	174,037,111.28	190,036,290.46

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的

金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。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，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	158,021,211.34	91.27	178,184,086.37	93.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	30,000.75	0.02	-	-
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	158,051,212.09	91.29	178,184,086.37	93.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。		
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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 1,592,728.24	增加约 1,658,646.00
	业绩比较基准下降 1%	减少约 1,592,728.24	减少约 1,658,646.00

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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 6 月 30 日
第一层次	157,738,316.45
第二层次	30,000.75
第三层次	282,894.89
合计	158,051,212.09

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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 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	158,021,211.34	90.34
	其中：股票	158,021,211.34	90.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,000.75	0.02
	其中：债券	30,000.75	0.02
	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	16,079,151.76	9.19
8	其他各项资产	791,613.64	0.45
9	合计	174,921,977.49	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	4,719,894.68	2.73
C	制造业	114,589,416.28	66.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,886,513.00	1.67
E	建筑业	1,438,420.00	0.83
F	批发和零售业	4,446,035.00	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	2,565,801.00	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,320,518.80	6.54
J	金融业	9,835,325.00	5.68

K	房地产业	1,151,172.00	0.66
L	租赁和商务服务业	1,283,678.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	1,406,825.58	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	2,377,612.00	1.37
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	158,021,211.34	91.27

7.2.2 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的股票。

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	2,073.00	3,909,678.00	2.26
2	300857	协创数据	8,600.00	2,923,140.00	1.69
3	002436	兴森科技	51,500.00	2,623,925.00	1.52
4	688469	芯联集成	197,009.00	2,090,265.49	1.21
5	688002	睿创微纳	13,240.00	2,048,095.60	1.18
6	688728	格科微	96,200.00	2,024,048.00	1.17
7	301526	国际复材	42,600.00	1,988,142.00	1.15
8	688220	翱捷科技	15,398.00	1,914,279.36	1.11
9	688200	华峰测控	3,600.00	1,890,360.00	1.09
10	688266	泽璟制药	15,770.00	1,839,728.20	1.06
11	688578	艾力斯	16,800.00	1,834,560.00	1.06
12	600885	宏发股份	51,200.00	1,765,888.00	1.02
13	688385	复旦微电	24,732.00	1,763,144.28	1.02
14	600601	方正科技	127,200.00	1,760,448.00	1.02
15	600497	驰宏锌锗	145,300.00	1,759,583.00	1.02
16	002738	中矿资源	29,500.00	1,740,205.00	1.01
17	688235	百济神州	6,833.00	1,739,750.13	1.00
18	688301	奕瑞科技	13,840.00	1,716,160.00	0.99
19	688213	思特威	15,705.00	1,681,534.35	0.97
20	002517	恺英网络	101,900.00	1,655,875.00	0.96

21	301536	星辰科技	12,700.00	1,634,617.00	0.94
22	002850	科达利	8,600.00	1,627,980.00	0.94
23	688027	国盾量子	3,200.00	1,612,832.00	0.93
24	601108	财通证券	186,300.00	1,611,495.00	0.93
25	300458	全志科技	40,700.00	1,606,022.00	0.93
26	300474	景嘉微	26,300.00	1,590,624.00	0.92
27	000034	神州数码	57,020.00	1,582,305.00	0.91
28	301358	湖南裕能	20,700.00	1,570,509.00	0.91
29	688180	君实生物	46,219.00	1,563,126.58	0.90
30	301377	鼎泰高科	2,832.00	1,560,148.80	0.90
31	601198	东兴证券	114,700.00	1,558,773.00	0.90
32	300953	震裕科技	11,540.00	1,542,898.00	0.89
33	601233	桐昆股份	69,700.00	1,509,005.00	0.87
34	688110	东芯股份	7,225.00	1,471,732.50	0.85
35	601665	齐鲁银行	253,900.00	1,465,003.00	0.85
36	688676	金盘科技	17,200.00	1,455,808.00	0.84
37	600884	杉杉股份	104,900.00	1,421,395.00	0.82
38	300012	华测检测	101,000.00	1,399,860.00	0.81
39	000967	盈峰环境	132,300.00	1,393,119.00	0.80
40	002266	浙富控股	271,200.00	1,372,272.00	0.79
41	300073	当升科技	28,500.00	1,369,140.00	0.79
42	000629	钒钛股份	409,700.00	1,368,398.00	0.79
43	002841	视源股份	39,500.00	1,363,935.00	0.79
44	600985	淮北矿业	96,800.00	1,360,040.00	0.79
45	600316	洪都航空	48,300.00	1,349,502.00	0.78
46	688709	成都华微	35,373.00	1,347,357.57	0.78
47	002064	华峰化学	140,200.00	1,330,498.00	0.77
48	000878	云南铜业	83,400.00	1,324,392.00	0.76
49	600363	联创光电	37,000.00	1,323,860.00	0.76
50	601997	贵阳银行	256,400.00	1,315,332.00	0.76
51	601156	东航物流	81,200.00	1,308,944.00	0.76
52	600536	中国软件	46,100.00	1,296,332.00	0.75
53	300627	华测导航	45,400.00	1,289,360.00	0.74
54	603077	和邦生物	553,500.00	1,284,120.00	0.74
55	000415	渤海租赁	315,400.00	1,283,678.00	0.74
56	688059	华锐精密	6,400.00	1,278,144.00	0.74
57	688593	新相微	32,800.00	1,276,576.00	0.74
58	688256	寒武纪	800.00	1,276,440.00	0.74
59	688692	达梦数据	5,205.00	1,271,529.45	0.73
60	600435	北方导航	113,300.00	1,268,960.00	0.73
61	000987	越秀资本	161,800.00	1,265,276.00	0.73
62	600166	福田汽车	434,600.00	1,264,686.00	0.73
63	000088	盐田港	307,300.00	1,256,857.00	0.73
64	688475	萤石网络	45,943.00	1,256,541.05	0.73

65	002683	广东宏大	42,900.00	1,256,541.00	0.73
66	600685	中船防务	49,100.00	1,249,104.00	0.72
67	600499	科达制造	90,300.00	1,246,140.00	0.72
68	002635	安洁科技	60,100.00	1,229,045.00	0.71
69	603939	益丰药房	67,800.00	1,219,044.00	0.70
70	000810	创维数字	91,200.00	1,208,400.00	0.70
71	000423	东阿阿胶	26,600.00	1,206,576.00	0.70
72	002152	广电运通	128,300.00	1,203,454.00	0.70
73	002923	润都股份	126,900.00	1,200,474.00	0.69
74	002929	润建股份	17,800.00	1,190,464.00	0.69
75	603338	浙江鼎力	28,000.00	1,190,000.00	0.69
76	600927	永安期货	95,400.00	1,187,730.00	0.69
77	000951	中国重汽	60,500.00	1,180,355.00	0.68
78	688766	普冉股份	1,539.00	1,179,797.40	0.68
79	603920	世运电路	24,500.00	1,176,980.00	0.68
80	003022	联泓新科	44,500.00	1,152,550.00	0.67
81	601155	新城控股	112,200.00	1,151,172.00	0.66
82	300927	江天化学	53,300.00	1,147,549.00	0.66
83	001286	陕西能源	112,300.00	1,138,722.00	0.66
84	600008	首创环保	414,000.00	1,126,080.00	0.65
85	301071	力量钻石	12,000.00	1,110,000.00	0.64
86	600801	华新建材	70,500.00	1,099,800.00	0.64
87	601666	平煤股份	153,700.00	1,098,955.00	0.63
88	002265	建设工业	61,600.00	1,071,840.00	0.62
89	603092	德力佳	19,200.00	1,036,224.00	0.60
90	688388	嘉元科技	23,400.00	1,029,600.00	0.59
91	300308	中际旭创	800.00	1,016,000.00	0.59
92	600292	电投水电	83,500.00	1,005,340.00	0.58
93	688717	艾罗能源	12,000.00	990,840.00	0.57
94	688668	鼎通科技	2,577.00	961,994.10	0.56
95	301268	铭利达	68,200.00	953,436.00	0.55
96	001337	四川黄金	25,600.00	938,496.00	0.54
97	603737	三棵树	38,500.00	927,850.00	0.54
98	601865	福莱特	87,700.00	921,727.00	0.53
99	603118	共进股份	75,100.00	909,461.00	0.53
100	600282	南钢股份	197,600.00	906,984.00	0.52
101	688099	晶晨股份	8,600.00	884,940.00	0.51
102	600704	物产中大	184,700.00	871,784.00	0.50
103	603000	人民网	53,200.00	786,828.00	0.45
104	000893	亚钾国际	18,000.00	736,020.00	0.43
105	601099	太平洋	217,400.00	732,638.00	0.42
106	600970	中材国际	102,600.00	731,538.00	0.42
107	600606	绿地控股	584,200.00	706,882.00	0.41
108	600369	西南证券	173,900.00	699,078.00	0.40

109	300604	长川科技	2,000.00	682,840.00	0.39
110	002281	光迅科技	2,600.00	668,044.00	0.39
111	688347	华虹宏力	1,800.00	605,340.00	0.35
112	300689	澄天伟业	8,400.00	589,512.00	0.34
113	002338	奥普光电	10,200.00	583,440.00	0.34
114	001309	德明利	600.00	565,740.00	0.33
115	001314	亿道信息	8,500.00	525,300.00	0.30
116	300136	信维通信	4,200.00	500,850.00	0.29
117	002101	广东鸿图	52,000.00	496,080.00	0.29
118	600739	辽宁成大	41,800.00	422,598.00	0.24
119	002532	天山铝业	38,500.00	413,105.00	0.24
120	600578	京能电力	51,300.00	330,885.00	0.19
121	601106	中国一重	97,100.00	320,430.00	0.19
122	000598	兴蓉环境	45,300.00	290,826.00	0.17
123	002340	格林美	43,900.00	290,179.00	0.17
124	002008	大族激光	1,800.00	270,198.00	0.16
125	000739	普洛药业	14,500.00	241,570.00	0.14
126	300134	大富科技	26,300.00	224,865.00	0.13
127	002187	广百股份	42,800.00	200,304.00	0.12
128	300475	香农芯创	500.00	150,000.00	0.09
129	301238	瑞泰新材	5,300.00	129,320.00	0.07
130	688120	华海清科	400.00	128,872.00	0.07
131	300146	汤臣倍健	10,100.00	91,304.00	0.05
132	001399	惠科股份	2,189.00	74,421.82	0.04
133	002273	水晶光电	2,000.00	70,960.00	0.04
134	001257	盛龙股份	2,566.00	65,862.68	0.04
135	300575	中旗股份	12,900.00	63,468.00	0.04
136	600808	马钢股份	23,100.00	57,750.00	0.03
137	002444	巨星科技	1,500.00	46,650.00	0.03
138	688818	电科蓝天	607.00	42,574.98	0.02
139	688809	强一股份	64.00	39,872.00	0.02
140	300957	贝泰妮	1,200.00	37,812.00	0.02
141	688820	盛合晶微	267.00	37,777.83	0.02
142	688712	北芯生命	817.00	29,346.64	0.02
143	300223	北京君正	100.00	24,890.00	0.01
144	688813	泰金新能	141.00	24,264.69	0.01
145	688785	恒运昌	52.00	24,083.80	0.01
146	301683	慧谷新材	119.00	15,881.25	0.01
147	688811	有研复材	566.00	13,657.58	0.01
148	301669	高特电子	438.00	13,508.52	0.01
149	301687	新广益	170.00	13,222.60	0.01
150	301513	尚水智能	182.00	10,440.85	0.01
151	301696	三瑞智能	114.00	9,957.94	0.01
152	603435	嘉德利	142.00	7,861.17	0.00

153	001365	天海电子	231.00	7,560.20	0.00
154	603257	中国瑞林	78.00	6,083.22	0.00
155	001393	维通利	137.00	5,341.63	0.00
156	603293	埃泰克	129.00	5,067.21	0.00
157	688816	易思维	84.00	4,796.40	0.00
158	301275	汉朔科技	97.00	4,355.30	0.00
159	601112	振石股份	241.00	4,275.03	0.00
160	603284	林平发展	106.00	3,742.37	0.00
161	001285	瑞立科密	80.00	3,290.40	0.00
162	001312	福恩股份	162.00	2,943.51	0.00
163	301173	毓恬冠佳	73.00	2,168.83	0.00
164	301491	汉桑科技	43.00	1,688.61	0.00
165	301668	昊创瑞通	45.00	1,480.50	0.00
166	301575	艾芬达	53.00	1,420.93	0.00
167	603271	永杰新材	26.00	1,155.70	0.00
168	603262	技源集团	43.00	1,058.66	0.00
169	603409	汇通控股	49.00	899.15	0.00
170	301632	广东建科	57.00	882.36	0.00
171	603370	华新精科	11.00	395.78	0.00
172	001356	富岭股份	9.00	74.34	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	002738	中矿资源	6,297,639.00	3.31
2	300857	协创数据	4,913,558.00	2.59
3	601233	桐昆股份	4,867,019.00	2.56
4	002436	兴森科技	4,001,043.00	2.11
5	688498	源杰科技	3,787,532.80	1.99
6	600601	方正科技	3,551,874.00	1.87
7	688037	芯源微	3,523,266.08	1.85
8	688220	翱捷科技	3,344,245.42	1.76
9	688301	奕瑞科技	3,205,854.55	1.69
10	002402	和而泰	3,114,174.00	1.64
11	002558	巨人网络	3,092,811.04	1.63
12	300474	景嘉微	3,017,591.00	1.59
13	301358	湖南裕能	3,010,908.00	1.58
14	603920	世运电路	2,987,043.00	1.57
15	688347	华虹宏力	2,976,713.46	1.57

16	688052	纳芯微	2,945,293.09	1.55
17	300432	富临精工	2,867,314.00	1.51
18	600536	中国软件	2,854,157.00	1.50
19	300012	华测检测	2,755,370.00	1.45
20	002683	广东宏大	2,747,760.56	1.45

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	300857	协创数据	7,022,332.00	3.70
2	002281	光迅科技	5,526,098.00	2.91
3	300454	深信服	5,120,923.00	2.69
4	603920	世运电路	4,830,360.00	2.54
5	002273	水晶光电	4,743,376.00	2.50
6	600549	厦门钨业	4,672,243.00	2.46
7	002738	中矿资源	4,392,272.00	2.31
8	002156	通富微电	4,252,508.00	2.24
9	688037	芯源微	4,195,937.86	2.21
10	300919	中伟新材	4,173,678.00	2.20
11	688295	中复神鹰	4,056,672.75	2.13
12	000933	神火股份	4,028,142.00	2.12
13	601233	桐昆股份	4,010,255.00	2.11
14	688281	华秦科技	3,971,767.18	2.09
15	603379	三美股份	3,713,100.00	1.95
16	300604	长川科技	3,690,981.00	1.94
17	600487	亨通光电	3,626,289.00	1.91
18	601168	西部矿业	3,510,351.00	1.85
19	601958	金钼股份	3,298,855.00	1.74
20	002138	顺络电子	3,290,190.00	1.73

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

买入股票的成本（成交）总额	503,387,171.73
卖出股票的收入（成交）总额	553,696,644.79

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	-	-
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）	30,000.75	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,000.75	0.02

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	118072	鼎通转债	170	17,000.52	0.01
2	118071	华峰转债	130	13,000.23	0.01

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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以

套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	791,613.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	791,613.64

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

本基金本报告期末前十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

无。

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
光大保德信中证 500 指数增强 A	1,548	46,838.96	12,742,236.53	17.57%	59,764,476.98	82.43%
光大保德信中证 500 指数增强 C	4,531	10,930.65	21,863,830.97	44.15%	27,662,937.04	55.85%
合计	6,079	20,074.60	34,606,067.50	28.36%	87,427,414.02	71.64%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。
2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	光大保德信中证 500 指数增强 A	423,985.37	0.58%
	光大保德信中证 500 指数增强 C	124,299.94	0.25%

	合计	548,285.31	0.45%
--	----	------------	-------

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的情况

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	光大保德信中证 500 指数增强 A	10~50
	光大保德信中证 500 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信中证 500 指数增强 A	-
	光大保德信中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金的份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信中证 500 指数增强 A	光大保德信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 29 日）基金份额总额	425,406,794.05	104,790,402.48
本报告期期初基金份额总额	104,550,125.19	52,630,138.33
本报告期基金总申购份额	17,190,946.27	52,566,227.52
减：本报告期基金总赎回份额	49,234,357.95	55,669,597.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	72,506,713.51	49,526,768.01

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

1、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，汪沛先生任董事长，王翠婷女士不再担任董事长。

2、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，黄波先生任副总经理兼首席投资总监，董文卓先生不再担任副总经理兼首席投资总监。

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动

已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人及其相关高级管理人员未受到任何调查或处罚。

10.7.2 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到任何调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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	
金融街证券股份 有限公司	2	1,056,496,834.14	100.00%	336,370.63	100.00%	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本报告期内本基金未新增租用证券交易单元，

本报告期内本基金未撤销租用证券交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、

低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

近两年未发生就交易席位方面的违约、侵权等各种纠纷或出现重大舆情事件；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报公司管理层（销售分管领导除外）批准。

经公司管理层（销售分管领导除外）批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.8.2 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		回购交易		权证交易	
	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
金融街证券股份有限公司	65,732.27	100.00%	-	-	-	-

10.9 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	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2025 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2026-01-01
2	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	同上	2026-01-22
3	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2026-03-28
4	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026-03-31
5	关于网站、微信服务号在线客服暂停使用的公告	同上	2026-04-03
6	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	同上	2026-04-14
7	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金(光大保德信中证 500 指数增强 A)基金产品资料概要更新	同上	2026-04-22
8	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金(光大保德信中证 500 指数增强 C)基金产品资料概要更新	同上	2026-04-22
9	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026-04-22
10	光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2026-04-22
11	光大保德信基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	同上	2026-06-06
12	关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	同上	2026-06-19

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

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

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、中国证监会批准光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话：4008-202-888。 公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日