

中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	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	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	59
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	59
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	59
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12	投资组合报告附注	59

§ 8	基金份额持有人信息	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9	开放式基金份额变动	62
§ 10	重大事件揭示	62
10.1	基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8	其他重大事件	64
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12	备查文件目录	65
12.1	备查文件目录	65
12.2	存放地点	65
12.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信保诚沪深 300 指数增强	
基金主代码	020160	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 18 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	154,737,161.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	020160	020161
报告期末下属分级基金的份额总额	25,855,670.74 份	128,881,491.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，在控制跟踪误差基础上，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过前述范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金，主要策略为复制标的指数，投资组合将以成份股在标的指数中的基准权重为基础，利用量化投资模型在一定范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。 基金管理人研发的量化投资模型借鉴国内外成熟的量化组合投资经验，运用多因子选股模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本的基础上，优化投资组合。 （1）多因子选股模型 本基金采用量化方法，以对中国股票市场的长期研究为基础，构建多因子模型，从多个维度捕捉市场有效性暂时缺失之处，

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

	合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。 4、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，研究资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，评估其内在价值。 5、可转换债券、可交换债券投资策略 本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，研究上市公司对转股价的修正和转股意愿。 6、衍生品投资策略 为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。 本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。 本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。 本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。 7、融资、转融通证券出借业务投资策略 本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。 利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。 为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，
--	--

	并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	杨军智
	联系电话	021-68649788	010-60834299
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		400-666-0066	010-60836588
传真		021-50120895	010-60834004
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		200120	100125
法定代表人		涂一锴	张佑君

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	9,811,386.55	6,828,945.19

本期利润	14,756,310.16	9,224,292.66
加权平均基金份额本期利润	0.1650	0.1087
本期加权平均净值利润率	11.68%	7.62%
本期基金份额净值增长率	10.00%	9.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C
期末可供分配利润	13,394,896.85	64,741,585.48
期末可供分配基金份额利润	0.5181	0.5023
期末基金资产净值	39,250,567.59	193,623,076.59
期末基金份额净值	1.5181	1.5023
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	51.81%	50.23%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚沪深 300 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	13.42%	1.22%	11.30%	1.19%	2.12%	0.03%
过去六个月	10.00%	1.11%	7.20%	1.07%	2.80%	0.04%
过去一年	25.65%	0.97%	25.13%	0.97%	0.52%	0.00%
自基金合同生效起至今	51.81%	1.03%	46.42%	1.10%	5.39%	-0.07%

中信保诚沪深 300 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	13.29%	1.22%	11.30%	1.19%	1.99%	0.03%
过去六个月	9.76%	1.10%	7.20%	1.07%	2.56%	0.03%
过去一年	25.13%	0.97%	25.13%	0.97%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	50.23%	1.03%	46.42%	1.10%	3.81%	-0.07%

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

中信保诚沪深 300 指数增强 A



中信保诚沪深 300 指数增强 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜鹏	基金经理	2023 年 12 月 18 日	-	11	姜鹏先生，经济学硕士。曾担任中交城市投资控股有限公司业务分析岗、杭州金达资产管理有限公司量化研究员。2017 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、投资经理。现任中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保

					诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合之间未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。本基金为指数增强型基金，股票投资方面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，通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求获得超越标的指数的投资收益。

上半年，A 股市场整体上行但出现极致分化，双创指数涨幅领先，大盘价值表现相对平淡。行业层面分化显著，通信、电子等科技板块遥遥领先，AI 与半导体产业链成为领涨主力；而传统周期与消费板块普遍承压，市场主线高度集中于科技成长方向。风格方面，高成长、高景气的科技风格持续占优，资金向 AI 算力产业链高度集中，电子行业总市值持续增长；量化因子方面，价值与红利、盈利等基本因子明显跑输，高频量价类与交易行为相关的因子表现较为突出。整体而言，上半年 A 股呈现结构性牛市特征，但个股分化加剧，资本市场的走势也体现出新旧增强动能切换过程的波动。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多因子量化投资策略为主，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取更高的超额收益。本基金在依据量化模型进行股票投资决策之外，采用股指期货多头套保管理流动性，并积极地参与科创板、创业板新股申购，力争为基金获取收益增厚机会。同时，本基金管理人秉承尽职尽责、为投资者负责的态度，认真谨慎的应对投资者的日常申赎等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚沪深 300 指数增强 A 份额净值增长率为 10.00%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；中信保诚沪深 300 指数增强 C 份额净值增长率为 9.76%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国经济在复杂的内外环境中保持总体平稳。一季度实现良好开局，二季度受内需走弱影响增速有所放缓，但仍有望实现全年增长目标。结构上，高新技术与装备制造业对工业增长贡献突出，新增长动能的培育工作持续推进，信息服务业、航空航天等高端制造投资保持较高增速；外需表现强劲，出口连创历史同期新高，集成电路、汽车等机电产品出口维持高增。内需方面，商品消费有所走弱，服务消费相对平稳；房地产市场延续筑底修复，核心城市销售边际改善。整体而言，上半年中国经济呈现“外需强、内需弱、新动能对冲旧动能”的结构性特征。

展望下半年宏观经济，国内预计将通过新质生产力培育与存量政策加速落地等方式，对冲内需偏弱的压力，平衡新旧动能转换的过渡期。出口端预计仍将维持结构性高景气，高技术产品出口有望延续强势；内需端预计将以扩内需、促消费为政策重心，服务消费、智能家居、AI 终端等新业态有望成为新增长支点。政策层面，预计将以加快存量财政政策落地执行为主，新型政策性金融工具等存量工具将在下半年加快形成实物工作量；货币政策料将保持支持性立场，保持流动性合理充裕。海外方面，地缘冲突缓和后能源价格回落有望减轻全球通胀压力，美联储年内维持利率不变概率较大，但加息预期仍存扰动。整体而言，下半年中国经济有望在存量政策发力与外需韧性支撑下保持稳中有进，新增长动能对冲旧动能的趋势预计将进一步强化。

展望下半年 A 股市场，预计将维持震荡上行、结构分化的格局。科技成长短期有所波动，但当下仍为核心主线，AI 产业革命持续深化，算力、光模块、半导体等方向基本面支撑扎实，但板块内部将从前期的极致抱团转向高低切换，资金预计更加关注可落地的商业模式，而非单一的资本支出；与此同时，部分业绩超预期的传统板块存在估值修复空间，市场风格有望迎来阶段性再平衡。配置上建议采取科技成长与稳健红利防御的哑铃策略，兼顾主线贝塔与超跌板块估值修复的均衡配置。当下市场的核心矛盾在于极致分化后的再平衡节奏，外部需警惕美联储加息预期及全球地缘超预期恶化的扰动，内部需关注科技板块业绩兑现度与内需复苏斜率。综合来看，对下半年 A 股市场保持中性偏乐观的态度，把握结构性机会。

基金投资方面，本基金将继续以稳定跑赢业绩基准为目标，从长期统计规律和金融逻辑的交集出发，依据量化模型筛选投资标的，适当控制行业和规模等风格暴露，力求降低产品跟踪误差。同时，适当参与网下新股申购等，力求提高收益，必要时本基金将采用股指期货多头套保以管理流动性。本基金珍惜持有人的投资和信任，将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责，力求为基金份额持有人谋求长期回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和

基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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，中信保诚基金管理有限公司在中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合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的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中信保诚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	16,784,474.49	21,125,680.71
结算备付金		1,589,787.46	7,332,716.77
存出保证金		750,204.00	1,773,798.00
交易性金融资产	6.4.7.2	213,823,461.58	286,821,843.42
其中：股票投资		213,781,947.43	286,742,937.56
基金投资		-	-
债券投资		41,514.15	78,905.86
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		288,095.86	11,582,658.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		233,236,023.39	328,636,697.44
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		32,251.32	4,918,632.09
应付管理人报酬		150,478.83	254,858.54
应付托管费		28,214.78	47,785.99
应付销售服务费		62,440.45	65,973.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,716.21	30,153.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	77,277.62	144,000.00
负债合计		362,379.21	5,461,404.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	154,737,161.85	235,081,129.39
未分配利润	6.4.7.8	78,136,482.33	88,094,163.65
净资产合计		232,873,644.18	323,175,293.04
负债和净资产总计		233,236,023.39	328,636,697.44

注：截止本报告期末，基金份额总额 154,737,161.85 份。其中：中信保诚沪深 300 指数增强 A 的基金份额净值 1.5181 元，基金份额总额 25,855,670.74 份；中信保诚沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值 1.5023 元，基金份额总额 128,881,491.11 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		25,460,655.16	13,615,897.47
1. 利息收入		26,891.26	81,152.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,891.26	81,152.26
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）		18,063,740.76	23,182,167.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,577,577.33	17,759,041.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	8,909.36	10.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.13	764,389.47	-258,394.21
股利收益	6.4.7.14	1,712,864.60	5,681,510.50
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.15	7,340,271.08	-9,972,400.02
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	29,752.06	324,977.26
减：二、营业总支出		1,480,052.34	3,091,743.30
1. 管理人报酬		984,430.38	1,988,932.88
2. 托管费		184,580.62	372,924.90
3. 销售服务费		236,877.65	640,622.60
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,754.74	-
8. 其他费用	6.4.7.18	71,408.95	89,262.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		23,980,602.82	10,524,154.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		23,980,602.82	10,524,154.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,980,602.82	10,524,154.17

6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	235,081,129.39	88,094,163.65	323,175,293.04
二、本期期初净资产	235,081,129.39	88,094,163.65	323,175,293.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-80,343,967.54	-9,957,681.32	-90,301,648.86
(一)、综合收益总额	-	23,980,602.82	23,980,602.82
(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)	-80,343,967.54	-33,938,284.14	-114,282,251.68
其中：1. 基金申购款	187,222,500.45	82,880,755.01	270,103,255.46
2. 基金赎回款	-267,566,467.99	- 116,819,039.15	-384,385,507.14
(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	154,737,161.85	78,136,482.33	232,873,644.18
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	435,544,186.14	78,000,024.06	513,544,210.20
二、本期期初净资产	435,544,186.14	78,000,024.06	513,544,210.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-63,398,527.89	-2,040,037.76	-65,438,565.65
（一）、综合收益总额	-	10,524,154.17	10,524,154.17
（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）	-63,398,527.89	-12,564,191.93	-75,962,719.82
其中：1. 基金申购款	1,137,898,364.75	193,395,611.29	1,331,293,976.04
2. 基金赎回款	-1,201,296,892.64	- 205,959,803.22	- 1,407,256,695.86
（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	372,145,658.25	75,959,986.30	448,105,644.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星

桂思毅

刘卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2023]2577 号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2023 年 12 月 18 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 423,606,798.64 份基金份额。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金合同》和《中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金

的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

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

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

致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值

税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	3,877,317.52
等于：本金	3,876,687.52
加：应计利息	630.00
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	12,907,156.97
等于：本金	12,906,984.63
加：应计利息	172.34
合计	16,784,474.49

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		197,962,222.33	—	213,781,947.43	15,819,725.10
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	29,800.00	29.23	41,514.15	11,684.92
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	29,800.00	29.23	41,514.15	11,684.92
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—

合计	197,992,022.33	29.23	213,823,461.58	15,831,410.02
----	----------------	-------	----------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,657,940.00	-	-	-
IF2609	2,789,460.00	-	-	-
IF2612	2,868,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,657,940.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	2.00	2,909,880.00	120,420.00
IF2612	IF2612	2.00	2,856,840.00	-11,640.00
合计				108,780.00
减：可抵销期货暂收款				108,780.00
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	11,900.75
应付信息披露费	59,507.37
其他	5,869.50
合计	77,277.62

6.4.7.7 实收基金

中信保诚沪深 300 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	124,234,778.59	124,234,778.59
本期申购	6,934,165.01	6,934,165.01
本期赎回（以“-”号填列）	-105,313,272.86	-105,313,272.86
本期末	25,855,670.74	25,855,670.74

中信保诚沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,846,350.80	110,846,350.80
本期申购	180,288,335.44	180,288,335.44
本期赎回（以“-”号填列）	-162,253,195.13	-162,253,195.13
本期末	128,881,491.11	128,881,491.11

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

中信保诚沪深 300 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	54,815,562.14	-7,588,202.50	47,227,359.64
本期期初	54,815,562.14	-7,588,202.50	47,227,359.64
本期利润	9,811,386.55	4,944,923.61	14,756,310.16
本期基金份额交易产生的变动数	-50,875,293.54	2,286,520.59	-48,588,772.95
其中：基金申购款	3,359,593.08	-506,340.16	2,853,252.92
基金赎回款	-54,234,886.62	2,792,860.75	-51,442,025.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,751,655.15	-356,758.30	13,394,896.85

中信保诚沪深 300 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	47,624,061.58	-6,757,257.57	40,866,804.01
本期期初	47,624,061.58	-6,757,257.57	40,866,804.01
本期利润	6,828,945.19	2,395,347.47	9,224,292.66
本期基金份额交易产生的变动数	12,117,070.38	2,533,418.43	14,650,488.81
其中：基金申购款	88,064,296.59	-8,036,794.50	80,027,502.09
基金赎回款	-75,947,226.21	10,570,212.93	-65,377,013.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,570,077.15	-1,828,491.67	64,741,585.48

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	7,080.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,907.97
结算备付金利息收入	15,903.22
其他	-
合计	26,891.26

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

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,732,050,511.42
减：卖出股票成本总额	1,714,711,428.30

减：交易费用	1,761,505.79
买卖股票差价收入	15,577,577.33

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	49.95
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	8,859.41
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	8,909.36

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,365.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,500.00
减：应计利息总额	4.34
减：交易费用	1.25
买卖债券差价收入	8,859.41

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	764,389.47

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,712,864.60
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	1,712,864.60

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,407,766.46
--股票投资	7,422,635.40
--债券投资	-14,868.94
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-69,771.43
--权证投资	-
--期货投资	-69,771.43
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,276.05
合计	7,340,271.08

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	29,274.95
转换费收入	477.11
合计	29,752.06

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	0.83
合计	71,408.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
上海信诚致远资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

中信证券股份有限公司	2,984,464,120.76	88.68%	3,811,951,952.02	63.30%
------------	------------------	--------	------------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中信证券股份有限公司	19,794.80	63.11%	26,200.00	75.94%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	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
中信证券股份有限公司	602,757.80	88.68%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期 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
中信证券股份有限公司	771,386.17	63.31%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、本报告期及上年度可比期间内券商为本基金提供交易单元租用服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	984,430.38	1,988,932.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	209,871.36	718,961.82
应支付基金管理人的净管理费	774,559.02	1,269,971.06

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	184,580.62	372,924.90

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C	合计
中信保诚基金管理有限公司	—	65,879.40	65,879.40
中信证券股份有限公司	—	112,902.77	112,902.77
合计	—	178,782.17	178,782.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C	合计
中信证券股份有限公司	—	487,962.46	487,962.46
合计	—	487,962.46	487,962.46

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

额基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

中信保诚沪深 300 指数增强 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		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
上海信诚致远资产管理有限公司	-	-	967,693.91	0.41%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	13,621,239.56	9,655.04	25,134,473.55	31,114.79

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信证券股份有限公司委托中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。本基金券商资金账户的存款为本基金存放于中信证券股份有限公司证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	锁定期股票	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	53.26	58.74	109	5,805.34	6,402.66	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	锁定期股票	27.19	31.31	271	7,368.49	8,485.01	-

		日								
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	锁定期股票	30.38	38.99	191	5,802.58	7,447.09	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	10.12	27.73	1,298	13,135.76	35,993.54	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	锁定期股票	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	锁定期股票	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	锁定期股票	13.91	32.47	323	4,492.93	10,487.81	-
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	锁定期股票	46.08	463.33	384	17,694.72	177,918.72	-
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	锁定期股票	58.00	112.16	89	5,162.00	9,982.24	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期股票	69.66	160.06	240	16,718.40	38,414.40	-
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	24.68	86.80	164	4,047.52	14,235.20	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	304	3,398.72	5,347.36	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	锁定期股票	33.49	33.93	47	1,574.03	1,594.71	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	锁定期股票	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	锁定期股票	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	15.76	46.71	72	1,134.72	3,363.12	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	17.70	84.32	171	3,026.70	14,418.72	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	110	4,507.80	33,900.90	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	1,266	22,180.32	45,474.72	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	锁定期股票	22.68	42.16	2,421	54,908.28	102,069.36	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	9 个月	锁定期股票	104.66	768.89	1,165	121,928.90	895,756.85	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	锁定期股票	55.95	57.10	119	6,658.05	6,794.90	-

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	筹划重大事项	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	1,100	720,141.47	915,200.00	-

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息，或基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。本基金的活期银行存款通过本基金的托管人存放在银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构的证券账户内，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	23,441.98	24,839.39
AAA 以下	18,072.17	54,066.47
未评级	—	—
合计	41,514.15	78,905.86

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

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

针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券

的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所或者银行间同业市场交易，除在期末本基金持有的流通受限证券章节部分所列示券种暂时受限制不能自由转让以外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	16,784,474.49	-	-	-	-	-	16,784,474.49
结算备付金	1,589,787.46	-	-	-	-	-	1,589,787.46
存出保证金	-	-	-	-	-	750,204.00	750,204.00
交易性金融资产	-	-	-	18,072.17	23,441.98	213,781,947.43	213,823,461.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	288,095.86	288,095.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,374,261.95	-	-	18,072.17	23,441.98	214,820,247.29	233,236,023.39
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,251.32	32,251.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	150,478.83	150,478.83
应付托管费	-	-	-	-	-	28,214.78	28,214.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	62,440.45	62,440.45
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11,716.21	11,716.21
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	77,277.62	77,277.62
负债总计	-	-	-	-	-	362,379.21	362,379.21
利率敏感度缺口	18,374,261.95	-	-	18,072.17	23,441.98	214,457,868.08	232,873,644.18
上年度末 2025 年 12 月 31	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

日							
资产							
货币资金	21,125,680.71	-	-	-	-	-	21,125,680.71
结算备付金	7,332,716.77	-	-	-	-	-	7,332,716.77
存出保证金	-	-	-	-	-	1,773,798.00	1,773,798.00
交易性金融资产	-	-	-	-	78,905.86	286,742,937.56	286,821,843.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	11,582,658.54	11,582,658.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,458,397.48	-	-	-	78,905.86	300,099,394.10	328,636,697.44
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,918,632.09	4,918,632.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	254,858.54	254,858.54
应付托管费	-	-	-	-	-	47,785.99	47,785.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,973.88	65,973.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	30,153.90	30,153.90
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	144,000.00	144,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	5,461,404.40	5,461,404.40
利率敏感度缺口	28,458,397.48	-	-	-	78,905.86	294,637,989.70	323,175,293.04

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

本报告期末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低，因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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。本报告期末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	213,781,947.43	91.80	286,742,937.56	88.73
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	41,514.15	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	213,823,461.58	91.82	286,742,937.56	88.73

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	11,295,119.58	14,724,259.18
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-11,295,119.58	-14,724,259.18

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	211,452,079.65	283,827,560.12
第二层次	915,200.00	2,183,037.00
第三层次	1,456,181.93	811,246.30
合计	213,823,461.58	286,821,843.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	213,781,947.43	91.66
	其中：股票	213,781,947.43	91.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	41,514.15	0.02
	其中：债券	41,514.15	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	18,374,261.95	7.88
8	其他各项资产	1,038,299.86	0.45
9	合计	233,236,023.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	810,771.00	0.35
B	采矿业	7,394,867.40	3.18
C	制造业	133,703,733.80	57.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,823,999.00	2.07
E	建筑业	1,997,826.00	0.86
F	批发和零售业	209,968.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	4,932,354.00	2.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,342,405.85	4.01
J	金融业	37,301,732.40	16.02

K	房地产业	1,221,835.00	0.52
L	租赁和商务服务业	650,711.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	2,627,161.00	1.13
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	194,110.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	80,957.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	205,292,431.45	88.16

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,122,177.52	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	334,928.00	0.14
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	282,079.46	0.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	372,185.00	0.16
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	378,146.00	0.16
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	8,489,515.98	3.65

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
1	300308	中际旭创	8,100	10,287,000.00	4.42
2	300750	宁德时代	20,880	8,206,048.80	3.52
3	300502	新易盛	10,148	6,159,836.00	2.65
4	600519	贵州茅台	4,300	5,097,607.00	2.19
5	603986	兆易创新	5,500	4,482,500.00	1.92
6	601318	中国平安	87,600	4,182,024.00	1.80
7	688256	寒武纪	2,147	3,425,645.85	1.47
8	600036	招商银行	86,248	3,061,804.00	1.31
9	688008	澜起科技	9,800	3,037,020.00	1.30
10	688041	海光信息	7,900	2,925,370.00	1.26
11	002384	东山精密	11,000	2,885,850.00	1.24
12	601899	紫金矿业	112,400	2,825,736.00	1.21
13	688981	中芯国际	17,500	2,779,350.00	1.19
14	300059	东方财富	130,400	2,657,552.00	1.14
15	603259	药明康德	21,100	2,627,161.00	1.13
16	601138	工业富联	34,700	2,503,605.00	1.08
17	601166	兴业银行	150,700	2,495,592.00	1.07
18	000333	美的集团	32,620	2,463,788.60	1.06
19	002371	北方华创	2,700	2,388,312.00	1.03
20	002475	立讯精密	33,598	2,365,299.20	1.02
21	000725	京东方 A	258,800	2,246,384.00	0.96
22	601211	国泰海通	121,702	2,214,976.40	0.95
23	688012	中微公司	4,545	2,129,332.50	0.91
24	600900	长江电力	79,500	2,104,365.00	0.90
25	300274	阳光电源	13,180	2,095,883.60	0.90
26	300408	三环集团	12,400	2,069,560.00	0.89
27	601398	工商银行	292,400	2,067,268.00	0.89
28	002463	沪电股份	12,600	1,925,280.00	0.83
29	300476	胜宏科技	5,500	1,905,365.00	0.82
30	000988	华工科技	9,600	1,772,256.00	0.76
31	600176	中国巨石	24,100	1,756,408.00	0.75
32	301308	江波龙	2,400	1,689,120.00	0.73
33	601288	农业银行	270,900	1,644,363.00	0.71
34	600522	中天科技	26,300	1,595,884.00	0.69
35	600183	生益科技	8,900	1,543,260.00	0.66
36	600584	长电科技	14,900	1,542,895.00	0.66
37	600150	中国船舶	43,790	1,479,664.10	0.64
38	603993	洛阳钼业	84,008	1,474,340.40	0.63

39	000338	潍柴动力	52,200	1,422,450.00	0.61
40	600276	恒瑞医药	26,640	1,386,345.60	0.60
41	002594	比亚迪	16,400	1,307,080.00	0.56
42	002916	深南电路	2,800	1,282,120.00	0.55
43	300394	天孚通信	3,840	1,162,291.20	0.50
44	300433	蓝思科技	21,600	1,159,056.00	0.50
45	600031	三一重工	64,200	1,109,376.00	0.48
46	002050	三花智控	25,000	1,095,750.00	0.47
47	300014	亿纬锂能	16,700	1,086,001.00	0.47
48	600549	厦门钨业	12,500	1,065,000.00	0.46
49	600919	江苏银行	91,000	980,980.00	0.42
50	000657	中钨高新	10,200	976,344.00	0.42
51	601328	交通银行	150,500	967,715.00	0.42
52	601939	建设银行	98,900	952,407.00	0.41
53	601988	中国银行	165,400	946,088.00	0.41
54	600016	民生银行	292,400	941,528.00	0.40
55	688126	沪硅产业	23,300	929,437.00	0.40
56	688072	拓荆科技	1,100	915,200.00	0.39
57	000651	格力电器	24,400	915,000.00	0.39
58	002938	鹏鼎控股	8,400	885,192.00	0.38
59	603799	华友钴业	18,300	883,158.00	0.38
60	300033	同花顺	3,580	862,780.00	0.37
61	601601	中国太保	29,200	832,784.00	0.36
62	002179	中航光电	18,000	831,600.00	0.36
63	000425	徐工机械	102,300	827,607.00	0.36
64	000938	紫光股份	28,600	825,396.00	0.35
65	300661	圣邦股份	5,700	817,836.00	0.35
66	601600	中国铝业	98,500	809,670.00	0.35
67	600887	伊利股份	33,400	800,264.00	0.34
68	688396	华润微	8,200	799,910.00	0.34
69	603019	中科曙光	7,300	782,779.00	0.34
70	601688	华泰证券	37,700	777,374.00	0.33
71	605117	德业股份	7,160	760,248.80	0.33
72	000977	浪潮信息	10,800	756,000.00	0.32
73	601658	邮储银行	152,800	753,304.00	0.32
74	688521	芯原股份	2,000	742,280.00	0.32
75	601872	招商轮船	41,900	736,183.00	0.32
76	000408	藏格矿业	10,600	734,792.00	0.32
77	000858	五 粮 液	9,900	732,600.00	0.31
78	601169	北京银行	146,400	717,360.00	0.31
79	601816	京沪高铁	148,500	672,705.00	0.29

80	600875	东方电气	22,900	658,833.00	0.28
81	600309	万华化学	9,400	643,054.00	0.28
82	002415	海康威视	18,500	632,700.00	0.27
83	002648	卫星化学	26,600	624,834.00	0.27
84	300124	汇川技术	9,400	623,502.00	0.27
85	600346	恒力石化	35,200	623,392.00	0.27
86	600809	山西汾酒	5,600	612,472.00	0.26
87	000100	TCL 科技	105,200	612,264.00	0.26
88	600111	北方稀土	12,700	610,235.00	0.26
89	300418	昆仑万维	15,100	609,436.00	0.26
90	600000	浦发银行	69,500	598,395.00	0.26
91	301269	华大九天	5,000	597,100.00	0.26
92	600011	华能国际	78,300	594,297.00	0.26
93	601788	光大证券	40,800	588,744.00	0.25
94	000063	中兴通讯	16,200	586,278.00	0.25
95	002532	天山铝业	54,100	580,493.00	0.25
96	601456	国联民生	65,600	579,904.00	0.25
97	601878	浙商证券	60,900	578,550.00	0.25
98	601058	赛轮轮胎	49,800	574,194.00	0.25
99	600089	特变电工	25,400	571,500.00	0.25
100	601857	中国石油	65,500	568,540.00	0.24
101	002142	宁波银行	19,000	564,110.00	0.24
102	601111	中国国航	93,100	563,255.00	0.24
103	600029	南方航空	108,700	563,066.00	0.24
104	601088	中国神华	13,800	538,752.00	0.23
105	002028	思源电气	3,000	519,000.00	0.22
106	000001	平安银行	50,600	508,530.00	0.22
107	600999	招商证券	23,900	504,290.00	0.22
108	601319	中国人保	74,200	501,592.00	0.22
109	001979	招商蛇口	77,300	497,039.00	0.21
110	600023	浙能电力	93,800	493,388.00	0.21
111	600918	中泰证券	92,400	491,568.00	0.21
112	000792	盐湖股份	16,000	483,040.00	0.21
113	002714	牧原股份	13,700	479,363.00	0.21
114	603369	今世缘	20,200	478,942.00	0.21
115	600406	国电南瑞	20,200	461,570.00	0.20
116	002353	杰瑞股份	3,000	457,500.00	0.20
117	601618	中国中冶	187,400	457,256.00	0.20
118	600515	海南机场	166,300	455,662.00	0.20
119	001965	招商公路	49,700	455,252.00	0.20
120	601668	中国建筑	104,400	453,096.00	0.19

121	000776	广发证券	19,000	444,600.00	0.19
122	600926	杭州银行	29,400	424,830.00	0.18
123	601919	中远海控	31,700	420,342.00	0.18
124	002602	世纪华通	29,700	418,770.00	0.18
125	300760	迈瑞医疗	3,000	407,490.00	0.17
126	601728	中国电信	78,400	406,896.00	0.17
127	600660	福耀玻璃	8,000	403,520.00	0.17
128	601012	隆基绿能	30,600	401,472.00	0.17
129	603501	豪威集团	4,200	398,370.00	0.17
130	601225	陕西煤业	19,500	396,825.00	0.17
131	002230	科大讯飞	9,600	392,064.00	0.17
132	600941	中国移动	4,500	387,585.00	0.17
133	600690	海尔智家	18,900	385,749.00	0.17
134	002352	顺丰控股	12,100	378,246.00	0.16
135	601985	中国核电	41,500	374,745.00	0.16
136	002460	赣锋锂业	5,600	366,240.00	0.16
137	002709	天赐材料	7,100	365,153.00	0.16
138	600160	巨化股份	6,800	360,468.00	0.15
139	601009	南京银行	35,800	354,062.00	0.15
140	300442	润泽科技	4,100	340,587.00	0.15
141	300498	温氏股份	26,900	331,408.00	0.14
142	002202	金风科技	13,800	329,820.00	0.14
143	600028	中国石化	73,600	328,256.00	0.14
144	600938	中国海油	12,000	325,800.00	0.14
145	601766	中国中车	61,500	319,800.00	0.14
146	002600	领益智造	18,400	319,056.00	0.14
147	002466	天齐锂业	5,200	318,864.00	0.14
148	600958	东方证券	33,700	318,128.00	0.14
149	600460	士兰微	5,800	317,028.00	0.14
150	600050	中国联通	79,000	316,000.00	0.14
151	002837	英维克	3,800	302,328.00	0.13
152	601628	中国人寿	8,400	296,940.00	0.13
153	002049	紫光国微	3,300	292,875.00	0.13
154	002241	歌尔股份	12,500	281,625.00	0.12
155	601818	光大银行	96,800	279,752.00	0.12
156	601100	恒立液压	2,600	279,656.00	0.12
157	000568	泸州老窖	3,600	279,072.00	0.12
158	603288	海天味业	8,400	278,544.00	0.12
159	601006	大秦铁路	60,200	277,522.00	0.12
160	601377	兴业证券	44,500	268,780.00	0.12
161	600905	三峡能源	72,200	267,862.00	0.12

162	601995	中金公司	7,400	267,510.00	0.11
163	600489	中金黄金	14,600	263,530.00	0.11
164	601888	中国中免	4,900	263,179.00	0.11
165	002625	光启技术	8,600	260,752.00	0.11
166	688082	盛美上海	600	259,200.00	0.11
167	601838	成都银行	14,600	258,420.00	0.11
168	000630	铜陵有色	40,600	258,216.00	0.11
169	000166	申万宏源	58,200	256,080.00	0.11
170	600010	包钢股份	114,400	255,112.00	0.11
171	600893	航发动力	6,600	253,044.00	0.11
172	601127	赛力斯	4,100	251,125.00	0.11
173	601825	沪农商行	33,500	250,915.00	0.11
174	002027	分众传媒	51,100	247,324.00	0.11
175	601336	新华保险	4,100	244,606.00	0.11
176	688271	联影医疗	2,400	242,952.00	0.10
177	601689	拓普集团	4,300	242,606.00	0.10
178	600019	宝钢股份	43,900	238,377.00	0.10
179	600118	中国卫星	2,900	237,945.00	0.10
180	600219	南山铝业	59,400	237,006.00	0.10
181	600760	中航沈飞	5,700	234,270.00	0.10
182	000807	云铝股份	10,500	232,470.00	0.10
183	600104	上汽集团	23,100	225,456.00	0.10
184	600362	江西铜业	5,200	225,160.00	0.10
185	600989	宝丰能源	11,000	223,630.00	0.10
186	601727	上海电气	31,800	222,600.00	0.10
187	300450	先导智能	5,400	219,888.00	0.09
188	002001	新 和 成	7,700	218,834.00	0.09
189	002422	科伦药业	5,600	215,712.00	0.09
190	601390	中国中铁	51,700	215,589.00	0.09
191	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.09
192	688183	生益电子	1,600	211,840.00	0.09
193	600015	华夏银行	33,100	211,509.00	0.09
194	600795	国电电力	45,000	210,150.00	0.09
195	000538	云南白药	4,400	208,428.00	0.09
196	600547	山东黄金	9,000	207,810.00	0.09
197	601916	浙商银行	78,700	206,981.00	0.09
198	600585	海螺水泥	12,100	205,095.00	0.09
199	601669	中国电建	43,500	204,450.00	0.09
200	603296	华勤技术	2,680	199,043.60	0.09
201	002736	国信证券	19,800	197,802.00	0.08
202	300015	爱尔眼科	23,500	194,110.00	0.08

203	300316	晶盛机电	3,200	193,280.00	0.08
204	601901	方正证券	26,600	191,520.00	0.08
205	601698	中国卫通	6,300	190,575.00	0.08
206	601868	中国能建	70,700	188,769.00	0.08
207	601077	渝农商行	30,700	187,577.00	0.08
208	600482	中国动力	5,700	186,960.00	0.08
209	002311	海大集团	4,100	182,901.00	0.08
210	002558	巨人网络	6,600	181,896.00	0.08
211	000625	长安汽车	25,000	179,250.00	0.08
212	600426	华鲁恒升	7,400	177,008.00	0.08
213	600066	宇通客车	6,600	176,946.00	0.08
214	601881	中国银河	13,900	174,723.00	0.08
215	000157	中联重科	25,000	174,250.00	0.07
216	603893	瑞芯微	900	169,524.00	0.07
217	605499	东鹏饮料	1,360	167,864.80	0.07
218	600048	保利发展	36,200	167,606.00	0.07
219	688036	传音控股	2,800	165,060.00	0.07
220	600438	通威股份	13,600	164,696.00	0.07
221	600115	中国东航	43,000	163,830.00	0.07
222	002236	大华股份	9,800	161,602.00	0.07
223	002493	荣盛石化	15,000	161,250.00	0.07
224	600886	国投电力	12,100	161,051.00	0.07
225	600570	恒生电子	7,600	161,044.00	0.07
226	600188	兖矿能源	8,900	158,153.00	0.07
227	300803	指南针	1,700	155,839.00	0.07
228	003816	中国广核	39,700	155,227.00	0.07
229	688047	龙芯中科	1,000	154,670.00	0.07
230	600436	片仔癀	1,400	152,992.00	0.07
231	601360	三六零	17,600	152,944.00	0.07
232	000301	东方盛虹	13,300	152,285.00	0.07
233	600026	中远海能	8,400	150,696.00	0.06
234	002074	国轩高科	5,400	148,554.00	0.06
235	600196	复星医药	6,400	143,808.00	0.06
236	600009	上海机场	6,200	143,220.00	0.06
237	000768	中航西飞	6,900	141,312.00	0.06
238	000975	山金国际	8,300	141,100.00	0.06
239	600415	小商品城	13,800	140,208.00	0.06
240	600674	川投能源	9,800	138,866.00	0.06
241	601186	中国铁建	23,200	138,040.00	0.06
242	601117	中国化学	18,500	135,975.00	0.06
243	600233	圆通速递	8,600	135,450.00	0.06

244	601877	正泰电器	5,300	132,871.00	0.06
245	600372	中航机载	12,100	131,285.00	0.06
246	301236	软通动力	3,000	127,350.00	0.05
247	000963	华东医药	4,400	123,728.00	0.05
248	600741	华域汽车	7,800	121,056.00	0.05
249	000895	双汇发展	5,220	116,928.00	0.05
250	002920	德赛西威	1,400	114,100.00	0.05
251	601898	中煤能源	9,250	112,665.00	0.05
252	002304	洋河股份	2,900	110,635.00	0.05
253	601021	春秋航空	2,400	109,392.00	0.05
254	600061	国投资本	16,500	108,075.00	0.05
255	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.04
256	600039	四川路桥	13,100	102,442.00	0.04
257	601800	中国交建	17,900	102,209.00	0.04
258	000002	万 科 A	34,300	101,528.00	0.04
259	601059	信达证券	6,200	100,378.00	0.04
260	688223	晶科能源	20,600	97,850.00	0.04
261	600588	用友网络	10,200	93,636.00	0.04
262	601633	长城汽车	6,200	93,558.00	0.04
263	600600	青岛啤酒	1,700	88,791.00	0.04
264	600027	华电国际	19,900	88,555.00	0.04
265	688506	百利天恒	300	88,209.00	0.04
266	601607	上海医药	5,600	86,240.00	0.04
267	300628	亿联网络	2,500	84,550.00	0.04
268	000617	中油资本	12,700	83,693.00	0.04
269	600025	华能水电	9,300	82,677.00	0.04
270	603260	合盛硅业	1,700	82,042.00	0.04
271	302132	中航成飞	1,400	81,648.00	0.04
272	300251	光线传媒	7,300	80,957.00	0.03
273	600930	华电新能	16,800	80,136.00	0.03
274	688472	阿特斯	7,300	78,986.00	0.03
275	600085	同仁堂	3,400	78,574.00	0.03
276	300832	新产业	1,800	75,600.00	0.03
277	000999	华润三九	3,300	74,217.00	0.03
278	600803	新奥股份	4,600	72,680.00	0.03
279	600018	上港集团	15,200	71,744.00	0.03
280	300122	智飞生物	6,000	70,140.00	0.03
281	600845	宝信软件	4,200	69,846.00	0.03
282	300999	金龙鱼	2,900	67,454.00	0.03
283	000596	古井贡酒	800	63,840.00	0.03
284	688009	中国通号	13,000	61,880.00	0.03

285	601018	宁波港	19,600	61,740.00	0.03
286	601238	广汽集团	11,100	56,388.00	0.02
287	688303	大全能源	3,200	55,776.00	0.02
288	300413	芒果超媒	3,700	54,131.00	0.02
289	001280	中国铀业	800	53,360.00	0.02
290	300896	爱美客	600	52,320.00	0.02
291	603392	万泰生物	1,800	48,546.00	0.02
292	301165	锐捷网络	600	48,270.00	0.02
293	601136	首创证券	3,400	47,430.00	0.02
294	001391	国货航	7,300	29,711.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688802	沐曦股份	1,165	895,756.85	0.38
2	688603	天承科技	2,000	415,900.00	0.18
3	002080	中材科技	4,500	405,000.00	0.17
4	688170	德龙激光	4,200	403,242.00	0.17
5	300948	冠中生态	14,200	378,146.00	0.16
6	600909	华安证券	33,500	372,185.00	0.16
7	301588	美新科技	8,500	371,960.00	0.16
8	688001	华兴源创	4,200	359,940.00	0.15
9	300998	宁波方正	12,800	356,224.00	0.15
10	002432	九安医疗	5,000	353,400.00	0.15
11	300576	容大感光	6,800	348,296.00	0.15
12	600186	莲花控股	24,400	341,600.00	0.15
13	002491	通鼎互联	10,400	336,960.00	0.14
14	600234	科新发展	12,100	334,928.00	0.14
15	300811	铂科新材	3,500	332,115.00	0.14
16	300593	新雷能	10,400	312,624.00	0.13
17	301111	粤万年青	12,000	310,560.00	0.13
18	300626	华瑞股份	8,700	303,456.00	0.13
19	300136	信维通信	2,500	298,125.00	0.13
20	300554	三超新材	10,400	285,480.00	0.12
21	601975	招商南油	75,200	280,496.00	0.12
22	301666	大普微	384	177,918.72	0.08
23	301071	力量钻石	1,300	120,250.00	0.05
24	688781	视涯科技	2,421	102,069.36	0.04
25	688712	北芯生命	1,266	45,474.72	0.02
26	301682	宏明电子	240	38,414.40	0.02

27	001399	惠科股份	1,298	35,993.54	0.02
28	688635	长进光子	110	33,900.90	0.01
29	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
30	603459	红板科技	171	14,418.72	0.01
31	301696	三瑞智能	164	14,235.20	0.01
32	688805	健信超导	265	12,447.05	0.01
33	301599	理奇智能	323	10,487.81	0.00
34	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
35	301680	固德电材	89	9,982.24	0.00
36	001365	天海电子	271	8,485.01	0.00
37	001393	维通利	191	7,447.09	0.00
38	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
39	688816	易思维	119	6,794.90	0.00
40	001237	惠康科技	109	6,402.66	0.00
41	601112	振石股份	304	5,347.36	0.00
42	603435	嘉德利	72	3,363.12	0.00
43	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
44	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
45	603293	埃泰克	47	1,594.71	0.00
46	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	12,362,294.60	3.83
2	600111	北方稀土	12,110,662.00	3.75
3	300274	阳光电源	11,663,997.00	3.61
4	300394	天孚通信	11,420,640.00	3.53
5	300750	宁德时代	10,769,042.00	3.33
6	300308	中际旭创	10,371,435.00	3.21
7	688041	海光信息	10,279,017.43	3.18
8	002384	东山精密	9,814,773.00	3.04
9	601138	工业富联	9,547,930.00	2.95
10	000792	盐湖股份	9,291,420.00	2.88
11	300476	胜宏科技	9,260,847.00	2.87
12	002460	赣锋锂业	9,142,010.00	2.83
13	603259	药明康德	9,114,897.00	2.82
14	688012	中微公司	9,114,196.60	2.82
15	600010	宝钢股份	8,936,676.00	2.77

16	601600	中国铝业	8,919,339.00	2.76
17	300124	汇川技术	8,898,870.00	2.75
18	002028	思源电气	8,679,924.00	2.69
19	603993	洛阳钼业	8,654,625.24	2.68
20	000408	藏格矿业	8,478,969.00	2.62
21	002709	天赐材料	8,455,910.00	2.62
22	300502	新易盛	8,427,532.00	2.61
23	601211	国泰海通	8,110,206.00	2.51
24	688981	中芯国际	8,102,838.58	2.51
25	600519	贵州茅台	8,088,049.00	2.50
26	600919	江苏银行	8,017,856.00	2.48
27	688256	寒武纪	8,007,673.50	2.48
28	600150	中国船舶	7,931,222.54	2.45
29	600000	浦发银行	7,781,686.00	2.41
30	603019	中科曙光	7,699,396.00	2.38
31	000425	徐工机械	7,689,368.00	2.38
32	002050	三花智控	7,670,090.00	2.37
33	600309	万华化学	7,596,189.50	2.35
34	603799	华友钴业	7,572,994.00	2.34
35	601225	陕西煤业	7,572,065.00	2.34
36	600089	特变电工	7,548,444.00	2.34
37	002371	北方华创	7,546,612.00	2.34
38	601601	中国太保	7,526,008.00	2.33
39	000338	潍柴动力	7,508,913.00	2.32
40	300059	东方财富	7,490,677.76	2.32
41	600522	中天科技	7,488,514.69	2.32
42	601009	南京银行	7,488,315.00	2.32
43	300014	亿纬锂能	7,446,726.00	2.30
44	000938	紫光股份	7,406,073.00	2.29
45	600183	生益科技	7,399,871.00	2.29
46	601318	中国平安	7,337,107.00	2.27
47	601398	工商银行	7,281,996.00	2.25
48	002916	深南电路	7,268,759.00	2.25
49	000651	格力电器	7,253,005.00	2.24
50	002625	光启技术	7,211,684.00	2.23
51	601899	紫金矿业	7,121,233.00	2.20
52	600031	三一重工	7,087,119.00	2.19
53	601012	隆基绿能	7,063,497.04	2.19
54	601939	建设银行	7,024,967.00	2.17
55	300782	卓胜微	7,006,839.00	2.17
56	002463	沪电股份	6,987,805.40	2.16

57	300033	同花顺	6,935,504.00	2.15
58	601872	招商轮船	6,921,798.00	2.14
59	300418	昆仑万维	6,911,237.46	2.14
60	600036	招商银行	6,871,591.54	2.13
61	000063	中兴通讯	6,845,601.00	2.12
62	601166	兴业银行	6,790,201.00	2.10
63	000725	京东方 A	6,704,490.00	2.07
64	600346	恒力石化	6,647,973.00	2.06
65	601390	中国中铁	6,605,663.00	2.04
66	601689	拓普集团	6,539,615.45	2.02
67	001979	招商蛇口	6,520,411.00	2.02

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	13,982,156.20	4.33
2	300308	中际旭创	13,919,026.00	4.31
3	688041	海光信息	11,490,683.21	3.56
4	300394	天孚通信	11,420,585.00	3.53
5	601899	紫金矿业	11,416,685.11	3.53
6	600111	北方稀土	11,415,312.16	3.53
7	603986	兆易创新	11,254,800.00	3.48
8	601318	中国平安	10,789,472.00	3.34
9	300502	新易盛	10,706,188.00	3.31
10	300274	阳光电源	10,479,215.00	3.24
11	688981	中芯国际	10,466,761.10	3.24
12	600519	贵州茅台	10,152,157.22	3.14
13	601600	中国铝业	10,125,754.00	3.13
14	601138	工业富联	10,022,718.00	3.10
15	600309	万华化学	9,533,987.70	2.95
16	600000	浦发银行	9,197,753.00	2.85
17	000651	格力电器	9,132,212.00	2.83
18	603259	药明康德	9,101,295.60	2.82
19	002475	立讯精密	9,098,649.00	2.82
20	601225	陕西煤业	9,093,388.00	2.81
21	002384	东山精密	9,084,781.00	2.81
22	000333	美的集团	9,075,775.00	2.81
23	000063	中兴通讯	9,058,508.36	2.80
24	603019	中科曙光	8,904,136.00	2.76

25	002460	赣锋锂业	8,836,599.80	2.73
26	600010	宝钢股份	8,816,036.00	2.73
27	600150	中国船舶	8,766,705.24	2.71
28	000408	藏格矿业	8,690,878.91	2.69
29	000792	盐湖股份	8,682,583.00	2.69
30	600036	招商银行	8,641,676.00	2.67
31	300476	胜宏科技	8,502,729.00	2.63
32	002028	思源电气	8,499,347.00	2.63
33	601939	建设银行	8,480,437.00	2.62
34	603993	洛阳钼业	8,368,801.00	2.59
35	300124	汇川技术	8,302,102.00	2.57
36	002709	天赐材料	8,296,177.99	2.57
37	601166	兴业银行	8,121,603.00	2.51
38	688012	中微公司	8,120,394.88	2.51
39	600887	伊利股份	7,978,240.00	2.47
40	605499	东鹏饮料	7,953,074.15	2.46
41	600066	宇通客车	7,819,957.00	2.42
42	688008	澜起科技	7,815,014.35	2.42
43	600690	海尔智家	7,689,118.00	2.38
44	600547	山东黄金	7,603,014.00	2.35
45	601211	国泰海通	7,564,170.56	2.34
46	001979	招商蛇口	7,538,989.64	2.33
47	601328	交通银行	7,515,111.00	2.33
48	600183	生益科技	7,494,740.87	2.32
49	300782	卓胜微	7,444,248.00	2.30
50	601100	恒立液压	7,431,880.00	2.30
51	601857	中国石油	7,343,695.00	2.27
52	600919	江苏银行	7,324,297.00	2.27
53	601601	中国太保	7,245,225.00	2.24
54	688256	寒武纪	7,226,621.83	2.24
55	600089	特变电工	7,170,290.00	2.22
56	601009	南京银行	7,114,762.00	2.20
57	600176	中国巨石	7,049,015.00	2.18
58	601398	工商银行	7,036,234.00	2.18
59	601872	招商轮船	7,033,845.00	2.18
60	000975	山金国际	7,028,090.64	2.17
61	601169	北京银行	7,001,324.00	2.17
62	002371	北方华创	6,898,331.26	2.13
63	601012	隆基绿能	6,865,852.20	2.12
64	000338	潍柴动力	6,859,399.00	2.12
65	600276	恒瑞医药	6,793,863.60	2.10

66	002463	沪电股份	6,705,746.60	2.07
67	000425	徐工机械	6,676,129.00	2.07
68	600522	中天科技	6,669,536.00	2.06
69	603799	华友钴业	6,607,996.00	2.04
70	300014	亿纬锂能	6,593,550.00	2.04
71	002916	深南电路	6,591,116.00	2.04
72	600031	三一重工	6,584,986.00	2.04
73	300033	同花顺	6,583,541.00	2.04
74	000938	紫光股份	6,562,349.00	2.03
75	002625	光启技术	6,558,065.00	2.03
76	002050	三花智控	6,541,340.00	2.02
77	601658	邮储银行	6,502,490.00	2.01

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,634,327,802.77
卖出股票收入（成交）总额	1,732,050,511.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	41,514.15	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,514.15	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	127110	广核转债	178	23,441.98	0.01
2	111022	锡振转债	120	18,072.17	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，报告编制日前一年内，招商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的经营状况，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,204.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	288,095.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,038,299.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127110	广核转债	23,441.98	0.01
2	111022	锡振转债	18,072.17	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688802	沐曦股份	895,756.85	0.38	锁定期股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信保诚沪深 300 指数增强 A	544	47,528.81	18,245,237.90	70.57%	7,610,432.84	29.43%
中信保诚沪深 300 指数增强 C	3,029	42,549.19	88,861,042.12	68.95%	40,020,448.99	31.05%
合计	3,573	43,307.35	107,106,280.02	69.22%	47,630,881.83	30.78%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚沪深 300 指数增强 A	4,195.76	0.02%
	中信保诚沪深 300 指数增强 C	40,491.66	0.03%
	合计	44,687.42	0.03%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚沪深 300 指数增强 A	0
	中信保诚沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚沪深 300 指数增强 A	0
	中信保诚沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚沪深 300 指数增强 A	中信保诚沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 12 月 18 日）基金份额总额	66,489,872.29	357,116,926.35
本报告期期初基金份额总额	124,234,778.59	110,846,350.80
本报告期基金总申购份额	6,934,165.01	180,288,335.44
减：本报告期基金总赎回份额	105,313,272.86	162,253,195.13
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	25,855,670.74	128,881,491.11

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	2,984,464,120.76	88.68%	602,757.80	88.68%	-
中信证券（山东）	2	381,069,735.53	11.32%	76,919.02	11.32%	-

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	19,794.80	63.11%	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	11,570.20	36.89%	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年01月21日
2	中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026年03月30日
3	中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026年04月21日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01 至 2026-06-30	84,379,929.27	85,211,509.43	84,379,929.27	85,211,509.43	55.07%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

中信保诚基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日