

中信保诚中证 A500 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..	15
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	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	56
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	58
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	58
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	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

7.12	投资组合报告附注	58
§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9	开放式基金份额变动	61
§ 10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	62
10.8	其他重大事件	62
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12	备查文件目录	63
12.1	备查文件目录	63
12.2	存放地点	63
12.3	查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信保诚中证 A500 指数增强	
基金主代码	025034	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 09 月 16 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	427,311,995.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025034	025035
报告期末下属分级基金的份额总额	220,517,197.84 份	206,794,797.95 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,通过数量化的方法进行积极的投资组合管理与风险控制,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为指数增强型基金,采用数量化的方法进行积极的投资组合管理与风险控制,力争控制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%,力求投资收益能够跟踪并适度超越业绩比较基准。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 2、债券投资策略 3、证券公司短期公司债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、可转换债券、可交换债券投资策略 6、衍生品投资策略 7、融资、转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外,还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票,将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	方圆
	联系电话	021-68649788	95559
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-666-0066	95559
传真		021-50120895	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		涂一锴	任德奇

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.citicprufunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	51,877,937.33	30,669,117.22
本期利润	54,105,763.02	30,657,684.66
加权平均基金份额本期利润	0.1552	0.1399
本期加权平均净值利润率	14.26%	12.87%
本期基金份额净值增长率	14.00%	13.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	33,973,304.28	31,099,832.36
期末可供分配基金份额利润	0.1541	0.1504
期末基金资产净值	260,261,571.25	243,295,566.76
期末基金份额净值	1.1802	1.1765
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	18.02%	17.65%

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 and 信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚中证 A500 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	15.86%	1.34%	13.54%	1.34%	2.32%	0.00%
过去六个月	14.00%	1.24%	11.34%	1.22%	2.66%	0.02%
自基金合同生 效起至今	18.02%	1.00%	15.14%	1.13%	2.88%	-0.13%

中信保诚中证 A500 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	15.75%	1.34%	13.54%	1.34%	2.21%	0.00%
过去六个月	13.77%	1.24%	11.34%	1.22%	2.43%	0.02%
自基金合同生 效起至今	17.65%	1.00%	15.14%	1.13%	2.51%	-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

中信保诚中证 A500 指数增强 A



中信保诚中证 A500 指数增强 C



注：1、本基金合同生效日为 2025 年 09 月 16 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金建仓期自 2025 年 09 月 16 日至 2026 年 03 月 16 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，本基金管理人于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”更名为“中信保诚基金管理有限公司”。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜鹏	基金经理	2025 年 09 月 16 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。
黄稚	量化投资部助理总监、基金经理	2025 年 09 月 16 日	-	14	黄稚女士，理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任量化投资部助理总监，中信保诚中证 500 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 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)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚国企红利量化选股股票型

					证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金、中信保诚恒生港股通科技主题指数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遵规守信情况的说明

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中证 A500 指数，业绩比较基准为：中证 A500 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超额收益。

上半年，A 股市场整体上行但出现分化，双创指数涨幅领先，大盘价值表现相对平淡。行业层面分化较为显著，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、盈利等基本因子较为落后，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，中信保诚中证 A500 指数增强 A 份额净值增长率为 14.00%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；中信保诚中证 A500 指数增强 C 份额净值增长率为 13.77%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

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；货币政策预计将保持支持性立场，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，但加息预期或仍存扰动。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或存在估值修复空间，市场风格有望迎来阶段性再平衡。可关注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。

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，基金托管人在中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中信保诚基金管理有限公司在中信保诚中证 A500 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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，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中证 A500 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：中信保诚中证 A500 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	45,944,588.69	91,775,323.51
结算备付金		5,305,111.64	11,863,772.06
存出保证金		2,959,585.80	4,001,460.00
交易性金融资产	6.4.7.2	450,565,699.29	892,536,836.50
其中：股票投资		450,565,699.29	892,536,836.50
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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		2,183,554.93	2,393,291.00
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		506,958,540.35	1,002,570,683.07
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		2,859,063.07	18,921,433.99
应付管理人报酬		298,970.33	792,917.73
应付托管费		37,371.28	99,114.72
应付销售服务费		61,732.70	136,372.00
应付投资顾问费		—	—
应交税费		56,646.73	58,479.69
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	87,618.23	76,984.00
负债合计		3,401,402.34	20,085,302.13
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	427,311,995.79	949,357,858.50
未分配利润	6.4.7.8	76,245,142.22	33,127,522.44
净资产合计		503,557,138.01	982,485,380.94
负债和净资产总计		506,958,540.35	1,002,570,683.07

注：截止本报告期末，基金份额总额 427,311,995.79 份。其中：中信保诚中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值 1.1802 元，基金份额总额 220,517,197.84 份；中信保诚中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值 1.1765 元，基金份额总额 206,794,797.95 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 A500 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
一、营业总收入		88,150,983.40
1. 利息收入		89,816.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	89,816.81
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）		85,779,916.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	78,059,626.23
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	3,973,241.22
股利收益	6.4.7.14	3,747,049.21
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	2,216,393.13
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	64,856.80
减：二、营业总支出		3,387,535.72
1. 管理人报酬		2,495,874.93
2. 托管费		311,984.38
3. 销售服务费		486,608.05
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		14,313.46
8. 其他费用	6.4.7.18	78,754.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,763,447.68
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,763,447.68
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		84,763,447.68

6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚中证 A500 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	949,357,858.50	33,127,522.44	982,485,380.94
二、本期期初净资产	949,357,858.50	33,127,522.44	982,485,380.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-522,045,862.71	43,117,619.78	-478,928,242.93
（一）、综合收益总额	-	84,763,447.68	84,763,447.68
（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）	-522,045,862.71	-41,645,827.90	-563,691,690.61
其中：1. 基金申购款	572,375,987.54	55,125,724.32	627,501,711.86
2. 基金赎回款	-1,094,421,850.25	-96,771,552.22	-1,191,193,402.47
（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	427,311,995.79	76,245,142.22	503,557,138.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星
基金管理人负责人

桂思毅
主管会计工作负责人

刘卓
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1497 号《关于准予中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由中信保诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集,基金合同于 2025 年 9 月 16 日正式生效。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 1, 217, 920, 907. 64 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司, 基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》, 本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等事项的不同, 将基金份额分为 A、C 两类。A 类基金份额在投资者认购、申购时收取认购、申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 但不从本类别基金财产中计提销售服务费; C 类基金份额从本类别基金财产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围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(含存托凭证)的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%; 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的, 以变更后的比例为准, 在履行适当程序后, 本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为: 中证 A500 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

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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[2016]36 号《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]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《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》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《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》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。对基金通过港股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。基金通过港股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。

(5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	18,457,867.05
等于：本金	18,456,400.45
加：应计利息	1,466.60
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	27,486,721.64
等于：本金	27,486,347.93
加：应计利息	373.71
合计	45,944,588.69

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		417,574,554.22	—	450,565,699.29	32,991,145.07
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		417,574,554.22	—	450,565,699.29	32,991,145.07

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	23,615,200.00	-	-	-
IC2612	3,253,000.00	-	-	-
IF2609	1,369,980.00	-	-	-
IF2612	15,698,340.00	-	-	-
IM2612	3,293,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,615,200.00	-	-	-

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
IC2612	IC2612	2.00	3,416,960.00	163,960.00
IF2609	IF2609	1.00	1,454,940.00	84,960.00
IF2612	IF2612	11.00	15,712,620.00	14,280.00
IM2612	IM2612	2.00	3,287,840.00	-6,040.00
合计				257,160.00
减：可抵销期货暂收款				257,160.00
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指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	18,843.91
应付信息披露费	59,507.37
其他	9,266.95
合计	87,618.23

6.4.7.7 实收基金

中信保诚中证 A500 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	620,952,429.67	620,952,429.67
本期申购	77,932,100.23	77,932,100.23
本期赎回（以“-”号填列）	-478,367,332.06	-478,367,332.06
本期末	220,517,197.84	220,517,197.84

中信保诚中证 A500 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	328,405,428.83	328,405,428.83
本期申购	494,443,887.31	494,443,887.31
本期赎回（以“-”号填列）	-616,054,518.19	-616,054,518.19
本期末	206,794,797.95	206,794,797.95

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

中信保诚中证 A500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	4,820,804.23	17,105,418.88	21,926,223.11
本期期初	4,820,804.23	17,105,418.88	21,926,223.11
本期利润	51,877,937.33	2,227,825.69	54,105,763.02
本期基金份额交易产生的变动数	-22,725,437.28	-13,562,175.44	-36,287,612.72
其中：基金申购款	5,155,784.45	2,339,254.47	7,495,038.92
基金赎回款	-27,881,221.73	-15,901,429.91	-43,782,651.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,973,304.28	5,771,069.13	39,744,373.41

中信保诚中证 A500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,163,574.51	9,037,724.82	11,201,299.33
本期期初	2,163,574.51	9,037,724.82	11,201,299.33
本期利润	30,669,117.22	-11,432.56	30,657,684.66
本期基金份额交易产生的变动数	-1,732,859.37	-3,625,355.81	-5,358,215.18
其中：基金申购款	35,596,079.85	12,034,605.55	47,630,685.40
基金赎回款	-37,328,939.22	-15,659,961.36	-52,988,900.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,099,832.36	5,400,936.45	36,500,768.81

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	29,918.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,013.03
结算备付金利息收入	49,885.32
其他	-
合计	89,816.81

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	2,078,422,819.63
减：卖出股票成本总额	1,998,363,631.27
减：交易费用	1,999,562.13

买卖股票差价收入	78,059,626.23
----------	---------------

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益—买卖债券差价收入。

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	3,973,241.22

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	3,747,049.21
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	3,747,049.21

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	3,418,786.74
--股票投资	3,418,786.74
--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	-1,242,940.00
--权证投资	-
--期货投资	-1,242,940.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-40,546.39
合计	2,216,393.13

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	64,856.80
合计	64,856.80

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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	3.62
证券开户费	400.00
合计	78,754.90

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,495,874.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,243,820.49
应支付基金管理人的净管理费	1,252,054.44

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
当期发生的基金应支付的托管费	311,984.38

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C	合计
交通银行股份有限公司	-	255,514.47	255,514.47
合计	-	255,514.47	255,514.47

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 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

本基金在本报告期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

本基金本报告期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, 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	18,457,867.05	29,918.46

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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	243	12,942.18	14,273.82	-
001248	华润新能	2026 年 06 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	10.11	10.11	7,081	71,588.91	71,588.91	-
001248	华润新能	2026 年 06 月 24 日	6 个月	锁定期股票	10.11	10.11	16,524	167,057.64	167,057.64	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	锁定期股票	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	锁定期股票	27.19	31.31	621	16,884.99	19,443.51	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	锁定期股票	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	10.12	27.73	2,563	25,937.56	71,071.99	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	锁定期股票	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	锁定期股票	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	锁定期股票	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普	2026 年	6 个月	锁定期	46.08	463.33	1,002	46,172.16	464,256.66	-

6	微	04 月 08 日		股票							
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	锁定期股票	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-	
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	锁定期股票	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-	
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期股票	69.66	160.06	671	46,741.86	107,400.26	-	
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期股票	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-	
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-	
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-	
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	72	2,411.28	2,442.96	-	
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	104	1,639.04	4,857.84	-	
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-	
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-	
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-	

		日								
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	锁定期股票	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	锁定期股票	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 09 日	9 个月	锁定期股票	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	44.56	468.67	192	8,555.52	89,984.64	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	9 个月	锁定期股票	104.66	768.89	3,627	379,601.82	2,788,764.03	-
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	锁定期股票	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026 年 04 月 01 日	6 个月	锁定期股票	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	锁定期股票	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	锁定期股票	19.68	141.49	953	18,755.04	134,839.97	-

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	1,600	876,683.23	1,331,200.00	-

					日					
--	--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

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 and 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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期债券投资。

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	45,944,588.69	-	-	-	-	-	45,944,588.69
结算备付金	5,305,111.64	-	-	-	-	-	5,305,111.64
存出保证金	-	-	-	-	-	2,959,585.80	2,959,585.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	450,565,699.29	450,565,699.29
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	-	-	-	-	-	2,183,554.93	2,183,554.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	51,249,700.33	-	-	-	-	455,708,840.02	506,958,540.35
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	-	-	-	-	-	2,859,063.07	2,859,063.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	298,970.33	298,970.33
应付托管费	-	-	-	-	-	37,371.28	37,371.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	61,732.70	61,732.70
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	56,646.73	56,646.73
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	87,618.23	87,618.23

负债总计	-	-	-	-	-	3,401,402.34	3,401,402.34
利率敏感度缺口	51,249,700.33	-	-	-	-	452,307,437.68	503,557,138.01
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	91,775,323.51	-	-	-	-	-	91,775,323.51
结算备付金	11,863,772.06	-	-	-	-	-	11,863,772.06
存出保证金	-	-	-	-	-	4,001,460.00	4,001,460.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	892,536,836.50	892,536,836.50
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	-	-	-	-	-	2,393,291.00	2,393,291.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	103,639,095.57	-	-	-	-	898,931,587.50	1,002,570,683.07
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	-	-	-	-	-	18,921,433.99	18,921,433.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	792,917.73	792,917.73
应付托管费	-	-	-	-	-	99,114.72	99,114.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	136,372.00	136,372.00
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	58,479.69	58,479.69
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	76,984.00	76,984.00
负债总计	-	-	-	-	-	20,085,302.13	20,085,302.13
利率敏感度缺口	103,639,095.57	-	-	-	-	878,846,285.37	982,485,380.94

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	450,565,699.29	89.48	892,536,836.50	90.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	450,565,699.29	89.48	892,536,836.50	90.84

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%	24, 150, 327. 39	14, 182, 415. 33
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-24, 150, 327. 39	-14, 182, 415. 33

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	443, 932, 321. 37	884, 333, 409. 68
第二层次	1, 569, 846. 55	5, 799, 326. 00
第三层次	5, 063, 531. 37	2, 404, 100. 82
合计	450, 565, 699. 29	892, 536, 836. 50

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	450,565,699.29	88.88
	其中：股票	450,565,699.29	88.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	51,249,700.33	10.11
8	其他各项资产	5,143,140.73	1.01
9	合计	506,958,540.35	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	853,756.00	0.17
B	采矿业	18,030,287.84	3.58
C	制造业	312,859,318.59	62.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,066,866.00	1.60
E	建筑业	4,368,086.00	0.87
F	批发和零售业	3,533,018.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,342,037.00	1.46
H	住宿和餐饮业	136,388.00	0.03

I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,591,950.80	3.89
J	金融业	42,336,804.00	8.41
K	房地产业	3,205,934.00	0.64
L	租赁和商务服务业	2,897,296.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	5,097,034.14	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	505,379.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	99,360.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,328,391.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	226,091.00	0.04
S	综合	531,942.00	0.11
	合计	431,009,939.37	85.59

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	36,149.82	0.01
C	制造业	15,171,550.09	3.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	238,646.55	0.05
E	建筑业	700,304.00	0.14
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	587,939.46	0.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	652,080.00	0.13
J	金融业	777,700.00	0.15
K	房地产业	597,816.00	0.12
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	793,574.00	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	19,555,759.92	3.88

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	14,400	18,288,000.00	3.63
2	300750	宁德时代	37,700	14,816,477.00	2.94
3	300502	新易盛	17,480	10,610,360.00	2.11
4	600519	贵州茅台	7,800	9,246,822.00	1.84
5	603986	兆易创新	10,100	8,231,500.00	1.63
6	601318	中国平安	158,200	7,552,468.00	1.50
7	688256	寒武纪	3,596	5,737,597.80	1.14
8	688008	澜起科技	18,300	5,671,170.00	1.13
9	300059	东方财富	270,900	5,520,942.00	1.10
10	688041	海光信息	14,700	5,443,410.00	1.08
11	600036	招商银行	147,200	5,225,600.00	1.04
12	688981	中芯国际	32,100	5,098,122.00	1.01
13	601899	紫金矿业	196,500	4,940,010.00	0.98
14	601211	国泰海通	253,100	4,606,420.00	0.91
15	000333	美的集团	56,700	4,282,551.00	0.85
16	002371	北方华创	4,800	4,245,888.00	0.84
17	002475	立讯精密	58,100	4,090,240.00	0.81
18	002384	东山精密	14,400	3,777,840.00	0.75
19	688012	中微公司	7,841	3,673,508.50	0.73
20	600900	长江电力	137,600	3,642,272.00	0.72
21	600487	亨通光电	32,800	3,586,352.00	0.71
22	002463	沪电股份	23,400	3,575,520.00	0.71
23	300476	胜宏科技	10,300	3,568,229.00	0.71
24	601288	农业银行	581,300	3,528,491.00	0.70
25	601398	工商银行	481,900	3,407,033.00	0.68
26	688525	佰维存储	6,800	3,364,164.00	0.67
27	300274	阳光电源	21,000	3,339,420.00	0.66
28	000988	华工科技	18,000	3,322,980.00	0.66
29	000725	京东方 A	381,900	3,314,892.00	0.66
30	603259	药明康德	26,414	3,288,807.14	0.65
31	600176	中国巨石	44,700	3,257,736.00	0.65
32	301308	江波龙	4,600	3,237,480.00	0.64
33	601166	兴业银行	186,700	3,091,752.00	0.61
34	600522	中天科技	48,600	2,949,048.00	0.59
35	600584	长电科技	27,800	2,878,690.00	0.57
36	603993	洛阳钼业	155,200	2,723,760.00	0.54
37	000338	潍柴动力	96,800	2,637,800.00	0.52

38	600183	生益科技	15,200	2,635,680.00	0.52
39	300136	信维通信	20,511	2,445,936.75	0.49
40	002916	深南电路	5,300	2,426,870.00	0.48
41	600276	恒瑞医药	45,234	2,353,977.36	0.47
42	300857	协创数据	6,900	2,345,310.00	0.47
43	002594	比亚迪	27,900	2,223,630.00	0.44
44	300223	君正股份	8,900	2,215,210.00	0.44
45	300433	蓝思科技	40,500	2,173,230.00	0.43
46	300408	三环集团	13,000	2,169,700.00	0.43
47	300475	香农芯创	6,900	2,070,000.00	0.41
48	002156	通富微电	27,000	2,048,490.00	0.41
49	300014	亿纬锂能	31,500	2,048,445.00	0.41
50	601988	中国银行	353,400	2,021,448.00	0.40
51	600549	厦门钨业	23,500	2,002,200.00	0.40
52	300394	天孚通信	6,380	1,931,098.40	0.38
53	300567	精测电子	6,000	1,905,600.00	0.38
54	000657	中钨高新	19,400	1,856,968.00	0.37
55	002050	三花智控	42,000	1,840,860.00	0.37
56	300346	南大光电	19,500	1,806,675.00	0.36
57	688126	沪硅产业	44,900	1,791,061.00	0.36
58	688777	中控技术	15,000	1,762,500.00	0.35
59	300757	罗博特科	2,800	1,733,200.00	0.34
60	688498	源杰科技	900	1,697,400.00	0.34
61	002938	鹏鼎控股	16,100	1,696,618.00	0.34
62	603799	华友钴业	34,630	1,671,243.80	0.33
63	002080	中材科技	18,500	1,665,000.00	0.33
64	300033	同花顺	6,840	1,648,440.00	0.33
65	002185	华天科技	73,300	1,635,323.00	0.32
66	002851	麦格米特	9,600	1,604,928.00	0.32
67	601658	邮储银行	325,100	1,602,743.00	0.32
68	688396	华润微	16,300	1,590,065.00	0.32
69	300395	菲利华	11,700	1,564,641.00	0.31
70	000938	紫光股份	53,900	1,555,554.00	0.31
71	688469	芯联集成	145,600	1,544,816.00	0.31
72	000651	格力电器	40,700	1,526,250.00	0.30
73	300390	天华新能	16,100	1,505,511.00	0.30
74	688017	绿的谐波	3,500	1,462,510.00	0.29
75	601600	中国铝业	177,700	1,460,694.00	0.29
76	300037	新宙邦	15,400	1,429,890.00	0.28
77	600141	兴发集团	29,900	1,404,403.00	0.28
78	603019	中科曙光	13,000	1,393,990.00	0.28

79	600150	中国船舶	40,467	1,367,379.93	0.27
80	600887	伊利股份	56,700	1,358,532.00	0.27
81	603650	彤程新材	13,700	1,342,326.00	0.27
82	688521	芯原股份	3,600	1,336,104.00	0.27
83	300604	长川科技	3,900	1,331,538.00	0.26
84	688072	拓荆科技	1,600	1,331,200.00	0.26
85	300661	圣邦股份	9,200	1,320,016.00	0.26
86	002126	银轮股份	26,400	1,314,720.00	0.26
87	002273	水晶光电	36,912	1,309,637.76	0.26
88	000977	浪潮信息	18,700	1,309,000.00	0.26
89	000960	锡业股份	30,500	1,302,045.00	0.26
90	300759	康龙化成	44,700	1,293,171.00	0.26
91	000858	五 粮 液	17,300	1,280,200.00	0.25
92	000066	中国长城	67,200	1,280,160.00	0.25
93	600988	赤峰黄金	48,600	1,279,152.00	0.25
94	605589	圣泉集团	20,100	1,277,757.00	0.25
95	601168	西部矿业	46,800	1,270,152.00	0.25
96	002648	卫星化学	51,700	1,214,433.00	0.24
97	002025	航天电器	15,700	1,196,654.00	0.24
98	601816	京沪高铁	263,200	1,192,296.00	0.24
99	601179	中国西电	79,900	1,192,108.00	0.24
100	300418	昆仑万维	29,500	1,190,620.00	0.24
101	688347	华虹宏力	3,500	1,177,050.00	0.23
102	300024	机器人	60,500	1,169,465.00	0.23
103	301358	湖南裕能	15,400	1,168,398.00	0.23
104	600011	华能国际	153,400	1,164,306.00	0.23
105	600309	万华化学	16,700	1,142,447.00	0.23
106	002415	海康威视	32,800	1,121,760.00	0.22
107	300124	汇川技术	16,900	1,120,977.00	0.22
108	600029	南方航空	214,600	1,111,628.00	0.22
109	601233	桐昆股份	51,100	1,106,315.00	0.22
110	002281	光迅科技	4,300	1,104,842.00	0.22
111	002008	大族激光	7,300	1,095,803.00	0.22
112	688120	华海清科	3,400	1,095,412.00	0.22
113	600111	北方稀土	22,600	1,085,930.00	0.22
114	000100	TCL 科技	186,500	1,085,430.00	0.22
115	002432	九安医疗	14,900	1,053,132.00	0.21
116	000733	振华科技	18,500	1,047,840.00	0.21
117	000063	中兴通讯	28,803	1,042,380.57	0.21
118	300558	贝达药业	15,900	1,034,613.00	0.21
119	600000	浦发银行	119,400	1,028,034.00	0.20

120	688676	金盘科技	12,100	1,024,144.00	0.20
121	600089	特变电工	45,200	1,017,000.00	0.20
122	002155	湖南黄金	42,600	1,016,862.00	0.20
123	601857	中国石油	116,000	1,006,880.00	0.20
124	601615	明阳智能	85,800	992,706.00	0.20
125	603806	福斯特	58,800	987,252.00	0.20
126	001979	招商蛇口	153,200	985,076.00	0.20
127	000967	盈峰环境	91,200	960,336.00	0.19
128	601088	中国神华	24,500	956,480.00	0.19
129	002028	思源电气	5,500	951,500.00	0.19
130	300432	富临精工	46,800	940,212.00	0.19
131	688390	固德威	8,600	933,186.00	0.19
132	600031	三一重工	53,100	917,568.00	0.18
133	600515	海南机场	334,100	915,434.00	0.18
134	601618	中国中冶	374,900	914,756.00	0.18
135	603979	金诚信	15,400	909,062.00	0.18
136	000415	渤海租赁	218,900	890,923.00	0.18
137	000932	华菱钢铁	256,300	889,361.00	0.18
138	600529	山东药玻	48,100	887,445.00	0.18
139	000001	平安银行	86,900	873,345.00	0.17
140	000887	中鼎股份	48,800	873,032.00	0.17
141	601601	中国太保	30,600	872,712.00	0.17
142	000792	盐湖股份	28,300	854,377.00	0.17
143	002714	牧原股份	24,400	853,756.00	0.17
144	600763	通策医疗	24,900	843,612.00	0.17
145	002353	杰瑞股份	5,400	823,500.00	0.16
146	600406	国电南瑞	35,900	820,315.00	0.16
147	601668	中国建筑	185,200	803,768.00	0.16
148	002436	兴森科技	15,100	769,345.00	0.15
149	601919	中远海控	56,200	745,212.00	0.15
150	002602	世纪华通	52,800	744,480.00	0.15
151	002230	科大讯飞	18,000	735,120.00	0.15
152	601728	中国电信	139,200	722,448.00	0.14
153	600660	福耀玻璃	14,299	721,241.56	0.14
154	300054	鼎龙股份	6,800	720,596.00	0.14
155	300760	迈瑞医疗	5,300	719,899.00	0.14
156	601012	隆基绿能	54,300	712,416.00	0.14
157	603501	豪威集团	7,500	711,375.00	0.14
158	601225	陕西煤业	34,700	706,145.00	0.14
159	600941	中国移动	8,000	689,040.00	0.14
160	600690	海尔智家	33,600	685,776.00	0.14

161	002352	顺丰控股	21,400	668,964.00	0.13
162	601985	中国核电	73,700	665,511.00	0.13
163	002460	赣锋锂业	10,000	654,000.00	0.13
164	002709	天赐材料	12,710	653,675.30	0.13
165	600160	巨化股份	12,000	636,120.00	0.13
166	300442	润泽科技	7,300	606,411.00	0.12
167	000425	徐工机械	73,400	593,806.00	0.12
168	002202	金风科技	24,700	590,330.00	0.12
169	300058	蓝色光标	42,800	588,928.00	0.12
170	002027	分众传媒	120,600	583,704.00	0.12
171	600028	中国石化	130,500	582,030.00	0.12
172	600938	中国海油	21,400	581,010.00	0.12
173	601766	中国中车	109,000	566,800.00	0.11
174	002600	领益智造	32,600	565,284.00	0.11
175	600460	士兰微	10,300	562,998.00	0.11
176	600050	中国联通	140,100	560,400.00	0.11
177	002466	天齐锂业	9,100	558,012.00	0.11
178	002837	英维克	6,850	544,986.00	0.11
179	002049	紫光国微	6,000	532,500.00	0.11
180	000683	博源化工	92,400	532,224.00	0.11
181	601628	中国人寿	14,900	526,715.00	0.10
182	002179	中航光电	11,300	522,060.00	0.10
183	002138	顺络电子	7,100	519,010.00	0.10
184	002625	光启技术	17,000	515,440.00	0.10
185	688002	睿创微纳	3,300	510,477.00	0.10
186	601872	招商轮船	28,900	507,773.00	0.10
187	002407	多氟多	10,100	507,323.00	0.10
188	601100	恒立液压	4,700	505,532.00	0.10
189	000568	泸州老窖	6,500	503,880.00	0.10
190	600879	航天电子	23,600	502,444.00	0.10
191	002241	歌尔股份	22,200	500,166.00	0.10
192	603288	海天味业	14,900	494,084.00	0.10
193	601006	大秦铁路	106,800	492,348.00	0.10
194	000408	藏格矿业	6,900	478,308.00	0.09
195	600905	三峡能源	128,100	475,251.00	0.09
196	605117	德业股份	4,420	469,315.60	0.09
197	600489	中金黄金	26,000	469,300.00	0.09
198	601888	中国中免	8,600	461,906.00	0.09
199	600760	中航沈飞	11,200	460,320.00	0.09
200	000630	铜陵有色	72,100	458,556.00	0.09
201	600893	航发动力	11,900	456,246.00	0.09

202	600010	包钢股份	202,700	452,021.00	0.09
203	600673	东阳光	13,400	449,972.00	0.09
204	601127	赛力斯	7,300	447,125.00	0.09
205	688271	联影医疗	4,400	445,412.00	0.09
206	601111	中国国航	73,300	443,465.00	0.09
207	601689	拓普集团	7,700	434,434.00	0.09
208	600118	中国卫星	5,200	426,660.00	0.08
209	688111	金山办公	2,000	426,100.00	0.08
210	600019	宝钢股份	78,000	423,540.00	0.08
211	000426	兴业银锡	12,600	415,296.00	0.08
212	000807	云铝股份	18,500	409,590.00	0.08
213	600104	上汽集团	41,100	401,136.00	0.08
214	300450	先导智能	9,800	399,056.00	0.08
215	600989	宝丰能源	19,600	398,468.00	0.08
216	600362	江西铜业	9,200	398,360.00	0.08
217	300751	迈为股份	1,400	395,444.00	0.08
218	601727	上海电气	56,400	394,800.00	0.08
219	600875	东方电气	13,600	391,272.00	0.08
220	002001	新 和 成	13,700	389,354.00	0.08
221	601390	中国中铁	91,700	382,389.00	0.08
222	002422	科伦药业	9,900	381,348.00	0.08
223	600885	宏发股份	11,000	379,390.00	0.08
224	600667	太极实业	13,000	379,340.00	0.08
225	002738	中矿资源	6,400	377,536.00	0.07
226	000538	云南白药	7,900	374,223.00	0.07
227	600547	山东黄金	16,200	374,058.00	0.07
228	600795	国电电力	79,800	372,666.00	0.07
229	600392	盛和资源	12,500	372,125.00	0.07
230	688099	晶晨股份	3,600	370,440.00	0.07
231	300083	创世纪	27,100	369,102.00	0.07
232	600418	江淮汽车	14,100	364,203.00	0.07
233	601669	中国电建	77,200	362,840.00	0.07
234	600585	海螺水泥	21,400	362,730.00	0.07
235	000831	中国稀土	6,500	360,685.00	0.07
236	002812	恩捷股份	5,200	347,932.00	0.07
237	002129	TCL 中环	28,900	347,378.00	0.07
238	300015	爱尔眼科	41,700	344,442.00	0.07
239	300316	晶盛机电	5,700	344,280.00	0.07
240	600096	云天化	11,300	343,520.00	0.07
241	601868	中国能建	125,400	334,818.00	0.07
242	600346	恒力石化	18,800	332,948.00	0.07

243	002195	岩山科技	50,800	332,232.00	0.07
244	300782	卓胜微	3,000	328,740.00	0.07
245	600482	中国动力	10,000	328,000.00	0.07
246	002558	巨人网络	11,900	327,964.00	0.07
247	600497	驰宏锌锗	27,000	326,970.00	0.06
248	600580	卧龙电驱	9,800	324,380.00	0.06
249	000625	长安汽车	44,400	318,348.00	0.06
250	600066	宇通客车	11,800	316,358.00	0.06
251	600426	华鲁恒升	13,200	315,744.00	0.06
252	600157	永泰能源	195,600	314,916.00	0.06
253	300803	指南针	3,400	311,678.00	0.06
254	002532	天山铝业	29,000	311,170.00	0.06
255	000157	中联重科	44,400	309,468.00	0.06
256	688036	传音控股	5,200	306,540.00	0.06
257	002340	格林美	46,300	306,043.00	0.06
258	600895	张江高科	8,200	305,450.00	0.06
259	600711	盛屯矿业	27,700	303,869.00	0.06
260	600570	恒生电子	14,200	300,898.00	0.06
261	000933	神火股份	14,100	298,920.00	0.06
262	600048	保利发展	64,300	297,709.00	0.06
263	600143	金发科技	19,100	295,095.00	0.06
264	600438	通威股份	24,100	291,851.00	0.06
265	600115	中国东航	76,300	290,703.00	0.06
266	300017	网宿科技	22,300	290,123.00	0.06
267	002236	大华股份	17,500	288,575.00	0.06
268	002493	荣盛石化	26,800	288,100.00	0.06
269	605499	东鹏饮料	2,310	285,123.30	0.06
270	300339	润和软件	7,400	284,974.00	0.06
271	600886	国投电力	21,400	284,834.00	0.06
272	600436	片仔癀	2,600	284,128.00	0.06
273	002456	欧菲光	30,000	283,800.00	0.06
274	600352	浙江龙盛	23,200	280,952.00	0.06
275	603659	璞泰来	9,600	277,728.00	0.06
276	002821	凯莱英	1,700	275,400.00	0.05
277	003816	中国广核	70,400	275,264.00	0.05
278	601360	三六零	31,300	271,997.00	0.05
279	601058	赛轮轮胎	23,500	270,955.00	0.05
280	000301	东方盛虹	23,600	270,220.00	0.05
281	002074	国轩高科	9,800	269,598.00	0.05
282	688213	思特威	2,500	267,675.00	0.05
283	600026	中远海能	14,900	267,306.00	0.05

284	688047	龙芯中科	1,700	262,939.00	0.05
285	688578	艾力斯	2,400	262,080.00	0.05
286	002555	三七互娱	13,800	260,406.00	0.05
287	300438	鹏辉能源	3,100	256,835.00	0.05
288	600009	上海机场	11,100	256,410.00	0.05
289	000768	中航西飞	12,400	253,952.00	0.05
290	600196	复星医药	11,300	253,911.00	0.05
291	000975	山金国际	14,900	253,300.00	0.05
292	300207	欣旺达	13,200	250,668.00	0.05
293	002465	海格通信	19,600	250,292.00	0.05
294	300001	特锐德	6,600	249,678.00	0.05
295	002472	双环传动	6,000	249,060.00	0.05
296	600415	小商品城	24,500	248,920.00	0.05
297	002517	恺英网络	15,300	248,625.00	0.05
298	600674	川投能源	17,400	246,558.00	0.05
299	600219	南山铝业	61,700	246,183.00	0.05
300	002601	龙佰集团	14,900	245,552.00	0.05
301	601186	中国铁建	41,100	244,545.00	0.05
302	002128	电投能源	10,507	242,921.84	0.05
303	601117	中国化学	32,800	241,080.00	0.05
304	600233	圆通速递	15,300	240,975.00	0.05
305	300458	全志科技	6,100	240,706.00	0.05
306	002595	豪迈科技	5,155	240,223.00	0.05
307	601877	正泰电器	9,500	238,165.00	0.05
308	000623	吉林敖东	13,400	237,582.00	0.05
309	300115	长盈精密	8,400	234,696.00	0.05
310	600372	中航机载	21,600	234,360.00	0.05
311	301236	软通动力	5,500	233,475.00	0.05
312	600839	四川长虹	33,000	230,340.00	0.05
313	603129	春风动力	900	230,220.00	0.05
314	688235	百济神州	900	229,149.00	0.05
315	300972	万辰集团	1,300	225,433.00	0.04
316	300568	星源材质	12,000	224,640.00	0.04
317	002414	高德红外	16,900	224,094.00	0.04
318	000963	华东医药	7,800	219,336.00	0.04
319	600741	华域汽车	14,100	218,832.00	0.04
320	000547	航天发展	11,300	216,395.00	0.04
321	300347	泰格医药	4,500	216,000.00	0.04
322	002130	沃尔核材	11,200	212,352.00	0.04
323	002920	德赛西威	2,600	211,900.00	0.04
324	300454	深信服	2,200	211,640.00	0.04

325	300496	中科创达	3,400	210,086.00	0.04
326	002497	雅化集团	10,300	209,811.00	0.04
327	300012	华测检测	15,000	207,900.00	0.04
328	000878	云南铜业	12,900	204,852.00	0.04
329	002271	东方雨虹	17,100	202,977.00	0.04
330	000034	神州数码	7,220	200,355.00	0.04
331	002444	巨星科技	6,400	199,040.00	0.04
332	601021	春秋航空	4,300	195,994.00	0.04
333	688331	荣昌生物	1,500	195,390.00	0.04
334	300474	景嘉微	3,200	193,536.00	0.04
335	601319	中国人保	28,600	193,336.00	0.04
336	300763	锦浪科技	2,100	189,735.00	0.04
337	300866	安克创新	1,800	188,100.00	0.04
338	600699	均胜电子	8,700	188,007.00	0.04
339	002078	太阳纸业	15,000	187,350.00	0.04
340	688266	泽璟制药	1,600	186,656.00	0.04
341	000661	长春高新	2,800	186,480.00	0.04
342	002756	永兴材料	3,269	185,156.16	0.04
343	300748	金力永磁	6,000	185,100.00	0.04
344	300142	沃森生物	14,200	184,458.00	0.04
345	601677	明泰铝业	11,100	184,260.00	0.04
346	300073	当升科技	3,800	182,552.00	0.04
347	600039	四川路桥	23,300	182,206.00	0.04
348	601800	中国交建	31,800	181,578.00	0.04
349	000002	万 科 A	61,000	180,560.00	0.04
350	300919	中伟新材	4,100	179,375.00	0.04
351	002252	上海莱士	41,300	179,242.00	0.04
352	603606	东方电缆	4,300	178,493.00	0.04
353	600226	亨通股份	18,500	177,415.00	0.04
354	000423	东阿阿胶	3,900	176,904.00	0.04
355	688599	天合光能	12,500	176,500.00	0.04
356	603087	甘李药业	3,100	175,956.00	0.03
357	688223	晶科能源	36,700	174,325.00	0.03
358	688169	石头科技	1,800	170,946.00	0.03
359	300724	捷佳伟创	2,400	169,440.00	0.03
360	600588	用友网络	18,300	167,994.00	0.03
361	002064	华峰化学	17,700	167,973.00	0.03
362	601633	长城汽车	11,100	167,499.00	0.03
363	688608	恒玄科技	1,000	167,190.00	0.03
364	001965	招商公路	18,100	165,796.00	0.03
365	000786	北新建材	9,100	164,619.00	0.03

366	300699	光威复材	5,700	163,305.00	0.03
367	688180	君实生物	4,800	162,336.00	0.03
368	002831	裕同科技	4,500	160,020.00	0.03
369	300677	英科医疗	4,000	156,680.00	0.03
370	002294	信立泰	4,900	156,261.00	0.03
371	000519	中兵红箭	7,400	155,918.00	0.03
372	600516	方大炭素	25,200	155,484.00	0.03
373	600177	雅戈尔	20,600	155,118.00	0.03
374	688065	凯赛生物	3,200	153,120.00	0.03
375	601607	上海医药	9,900	152,460.00	0.03
376	302132	中航成飞	2,600	151,632.00	0.03
377	002065	东华软件	21,200	151,368.00	0.03
378	603260	合盛硅业	3,100	149,606.00	0.03
379	000617	中油资本	22,600	148,934.00	0.03
380	600862	中航高科	8,200	147,846.00	0.03
381	688506	百利天恒	500	147,015.00	0.03
382	002085	万丰奥威	13,200	146,388.00	0.03
383	300251	光线传媒	13,000	144,170.00	0.03
384	002318	久立特材	6,000	143,400.00	0.03
385	002459	晶澳科技	17,700	143,370.00	0.03
386	300832	新产业	3,400	142,800.00	0.03
387	002266	浙富控股	27,900	141,174.00	0.03
388	300342	天银机电	3,000	141,000.00	0.03
389	600085	同仁堂	6,100	140,971.00	0.03
390	600499	科达制造	10,200	140,760.00	0.03
391	688472	阿特斯	13,000	140,660.00	0.03
392	002044	美年健康	27,900	140,337.00	0.03
393	603596	伯特利	5,640	140,097.60	0.03
394	605090	九丰能源	3,700	137,529.00	0.03
395	300409	道氏技术	6,900	137,517.00	0.03
396	000400	许继电气	6,300	136,710.00	0.03
397	300003	乐普医疗	11,500	136,275.00	0.03
398	002223	鱼跃医疗	5,300	135,998.00	0.03
399	601216	君正集团	30,200	134,692.00	0.03
400	688188	柏楚电子	1,260	134,442.00	0.03
401	600521	华海药业	9,300	133,920.00	0.03
402	000039	中集集团	16,400	133,004.00	0.03
403	000999	华润三九	5,900	132,691.00	0.03
404	000032	深桑达 A	5,300	132,235.00	0.03
405	600704	物产中大	27,700	130,744.00	0.03
406	603766	隆鑫通用	10,900	130,037.00	0.03

407	600803	新奥股份	8,200	129,560.00	0.03
408	301550	斯菱智驱	1,400	128,002.00	0.03
409	600018	上港集团	27,000	127,440.00	0.03
410	600312	平高电气	7,200	127,152.00	0.03
411	603605	珀莱雅	2,100	125,832.00	0.02
412	300122	智飞生物	10,700	125,083.00	0.02
413	600332	白云山	6,200	124,248.00	0.02
414	600765	中航重机	9,600	124,032.00	0.02
415	600166	福田汽车	42,500	123,675.00	0.02
416	600153	建发股份	15,500	122,915.00	0.02
417	000830	鲁西化工	10,200	122,400.00	0.02
418	688116	天奈科技	3,200	122,240.00	0.02
419	002410	广联达	14,700	119,952.00	0.02
420	002007	华兰生物	9,800	119,462.00	0.02
421	600323	瀚蓝环境	4,300	118,078.00	0.02
422	300896	爱美客	1,300	113,360.00	0.02
423	688114	华大智造	2,200	112,376.00	0.02
424	603568	伟明环保	7,300	112,274.00	0.02
425	600398	海澜之家	21,400	111,922.00	0.02
426	002603	以岭药业	7,400	111,000.00	0.02
427	601000	唐山港	26,500	109,975.00	0.02
428	688009	中国通号	23,100	109,956.00	0.02
429	601018	宁波港	34,800	109,620.00	0.02
430	601799	星宇股份	1,200	108,744.00	0.02
431	002389	航天彩虹	6,100	108,397.00	0.02
432	600208	衢州发展	38,000	107,540.00	0.02
433	600008	首创环保	39,400	107,168.00	0.02
434	600486	扬农化工	2,100	106,470.00	0.02
435	600316	洪都航空	3,800	106,172.00	0.02
436	000738	航发控制	5,800	106,082.00	0.02
437	600998	九州通	22,600	105,994.00	0.02
438	600170	上海建工	47,700	105,894.00	0.02
439	600820	隧道股份	19,700	102,637.00	0.02
440	688303	大全能源	5,800	101,094.00	0.02
441	300118	东方日升	8,100	100,845.00	0.02
442	600161	天坛生物	8,700	100,746.00	0.02
443	601238	广汽集团	19,800	100,584.00	0.02
444	603885	吉祥航空	9,700	99,813.00	0.02
445	002607	中公教育	55,200	99,360.00	0.02
446	603486	科沃斯	1,900	96,425.00	0.02
447	603816	顾家家居	4,300	96,148.00	0.02

448	603939	益丰药房	5,300	95,294.00	0.02
449	601567	三星电气	6,200	92,628.00	0.02
450	300676	华大基因	2,600	91,156.00	0.02
451	601880	辽港股份	66,000	91,080.00	0.02
452	600038	中直股份	3,600	91,044.00	0.02
453	688166	博瑞医药	2,600	91,026.00	0.02
454	600864	哈投股份	17,500	90,825.00	0.02
455	688617	惠泰医疗	500	90,780.00	0.02
456	300573	兴齐眼药	2,200	89,672.00	0.02
457	300049	福瑞医科	2,300	89,424.00	0.02
458	603392	万泰生物	3,300	89,001.00	0.02
459	600535	天士力	6,600	87,318.00	0.02
460	600816	建元信托	35,200	85,888.00	0.02
461	002244	滨江集团	11,100	84,360.00	0.02
462	300100	双林股份	3,000	83,340.00	0.02
463	600511	国药股份	3,200	83,328.00	0.02
464	601155	新城控股	8,100	83,106.00	0.02
465	002120	韵达股份	12,900	82,044.00	0.02
466	000833	粤桂股份	3,500	81,970.00	0.02
467	300144	宋城演艺	14,100	81,921.00	0.02
468	601866	中远海发	34,900	77,129.00	0.02
469	600064	南京高科	10,800	77,004.00	0.02
470	002544	普天科技	4,200	76,524.00	0.02
471	688063	派能科技	1,400	74,578.00	0.01
472	600635	大众公用	17,200	73,616.00	0.01
473	000035	中国天楹	14,900	71,967.00	0.01
474	600754	锦江酒店	4,000	71,960.00	0.01
475	300457	赢合科技	3,400	71,672.00	0.01
476	600655	豫园股份	17,300	71,103.00	0.01
477	300601	康泰生物	5,900	66,906.00	0.01
478	600004	白云机场	9,100	66,066.00	0.01
479	603899	晨光股份	3,200	66,016.00	0.01
480	600663	陆家嘴	10,400	65,312.00	0.01
481	600258	首旅酒店	5,900	64,428.00	0.01
482	600859	王府井	6,900	63,342.00	0.01
483	002091	江苏国泰	8,700	62,901.00	0.01
484	300070	碧水源	19,400	61,886.00	0.01
485	000069	华侨城 A	35,900	58,876.00	0.01
486	301078	孩子王	7,800	52,728.00	0.01
487	002292	奥飞娱乐	7,800	51,168.00	0.01
488	600325	华发股份	19,700	45,507.00	0.01

489	002891	中宠股份	1,700	45,424.00	0.01
490	603833	欧派家居	1,500	45,165.00	0.01
491	002572	索菲亚	5,100	37,230.00	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	3,627	2,788,764.03	0.55
2	688170	德龙激光	8,800	844,888.00	0.17
3	300948	冠中生态	29,800	793,574.00	0.16
4	301588	美新科技	17,800	778,928.00	0.15
5	600909	华安证券	70,000	777,700.00	0.15
6	688001	华兴源创	8,900	762,730.00	0.15
7	002980	华盛昌	6,400	745,856.00	0.15
8	300998	宁波方正	26,700	743,061.00	0.15
9	300576	容大感光	14,300	732,446.00	0.15
10	600186	莲花控股	51,000	714,000.00	0.14
11	002975	博杰股份	5,000	710,000.00	0.14
12	002491	通鼎互联	21,700	703,080.00	0.14
13	600234	科新发展	25,300	700,304.00	0.14
14	300593	新雷能	21,700	652,302.00	0.13
15	301111	粤万年青	25,200	652,176.00	0.13
16	301313	凡拓数创	13,000	652,080.00	0.13
17	300626	华瑞股份	18,300	638,304.00	0.13
18	301312	智立方	5,300	614,853.00	0.12
19	600791	京能置业	68,400	597,816.00	0.12
20	601975	招商南油	157,200	586,356.00	0.12
21	002910	庄园牧场	45,600	505,248.00	0.10
22	301666	大普微	1,002	464,256.66	0.09
23	301188	力诺药包	5,200	347,880.00	0.07
24	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.06
25	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.05
26	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.05
27	001248	华润新能	23,605	238,646.55	0.05
28	688820	盛合晶微	953	134,839.97	0.03
29	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
30	301682	宏明电子	671	107,400.26	0.02
31	688797	臻宝科技	192	89,984.64	0.02
32	001399	惠科股份	2,563	71,071.99	0.01
33	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
34	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01

35	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
36	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
37	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
38	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
39	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
40	001365	天海电子	621	19,443.51	0.00
41	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
42	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
43	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
44	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
45	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
46	001237	惠康科技	243	14,273.82	0.00
47	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
48	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
49	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
50	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
51	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
52	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
53	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
54	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
55	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
56	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
57	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
58	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	688981	中芯国际	9,356,045.60	0.95
2	300750	宁德时代	9,152,475.00	0.93
3	603986	兆易创新	8,753,145.00	0.89
4	688008	澜起科技	8,597,082.71	0.88
5	601318	中国平安	8,201,628.00	0.83
6	688041	海光信息	8,135,609.10	0.83
7	600487	亨通光电	8,069,576.00	0.82
8	300502	新易盛	7,873,786.20	0.80
9	300476	胜宏科技	7,669,908.00	0.78
10	002384	东山精密	7,649,243.00	0.78
11	600519	贵州茅台	7,549,877.02	0.77

12	600183	生益科技	7,505,211.00	0.76
13	300757	罗博特科	7,272,201.00	0.74
14	300308	中际旭创	7,111,352.00	0.72
15	603259	药明康德	7,106,061.00	0.72
16	688256	寒武纪	7,035,301.81	0.72
17	000338	潍柴动力	7,004,031.00	0.71
18	300394	天孚通信	6,635,315.00	0.68
19	002916	深南电路	6,245,838.00	0.64
20	300059	东方财富	6,214,626.00	0.63

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	25,790,167.00	2.62
2	600519	贵州茅台	22,660,939.50	2.31
3	300308	中际旭创	20,811,998.00	2.12
4	601318	中国平安	18,797,286.95	1.91
5	601899	紫金矿业	16,831,463.00	1.71
6	300502	新易盛	16,046,303.80	1.63
7	600036	招商银行	14,220,028.00	1.45
8	300059	东方财富	13,019,110.00	1.33
9	000333	美的集团	12,824,265.33	1.31
10	688981	中芯国际	12,563,402.48	1.28
11	688256	寒武纪	12,359,118.97	1.26
12	601166	兴业银行	11,787,410.00	1.20
13	603259	药明康德	11,429,925.80	1.16
14	688041	海光信息	11,311,358.43	1.15
15	002384	东山精密	11,268,630.10	1.15
16	603986	兆易创新	10,770,691.00	1.10
17	600276	恒瑞医药	10,586,674.10	1.08
18	300476	胜宏科技	10,478,194.00	1.07
19	688008	澜起科技	10,311,475.80	1.05
20	002475	立讯精密	10,237,206.80	1.04

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	1,552,973,707.32
卖出股票收入(成交)总额	2,078,422,819.63

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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对冲流动性风险，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均没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理

委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,959,585.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,183,554.93
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,143,140.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	2,788,764.03	0.55	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 中证 A500 指数增强 A	1,522	144,886.46	4,590.85	0.00%	220,512,606.99	100.00%
中信保诚 中证 A500 指数增强 C	1,618	127,808.90	2,260,998.65	1.09%	204,533,799.30	98.91%
合计	3,140	136,086.62	2,265,589.50	0.53%	425,046,406.29	99.47%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚中证 A500 指数增强 A	399,477.33	0.18%
	中信保诚中证 A500 指数增强 C	—	—
	合计	399,477.33	0.09%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚中证 A500 指数增强 A	10~50
	中信保诚中证 A500 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚中证 A500 指数增强 A	0~10
	中信保诚中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 A500 指数增强 A	中信保诚中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 09 月 16 日）基金份额总额	795,782,053.45	422,138,854.19
本报告期期初基金份额总额	620,952,429.67	328,405,428.83
本报告期基金总申购份额	77,932,100.23	494,443,887.31
减：本报告期基金总赎回份额	478,367,332.06	616,054,518.19
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	220,517,197.84	206,794,797.95

§ 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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化，为德勤华永会计师事务所（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的托管业务部门未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	378,348,968.41	10.43%	74,113.02	10.19%	-
中信证券	2	3,250,458,864.93	89.57%	653,459.29	89.81%	-

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《中国证券报》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	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026年03月30日
3	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026年04月21日
4	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资	同上	2026年05月29日

	基金（C 类份额）基金产品资料概要更新		
5	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2026年05月29日
6	中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 5 月）	同上	2026年05月29日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚中证 A500 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