

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 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,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	6
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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	14
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遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	19
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	57
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	59
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	期末上市基金前十名持有人 .....	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.4	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 .....	62
8.5	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 .....	63
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8	其他重大事件 .....	67
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
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 .....	68
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§ 12	备查文件目录 .....	68
12.1	备查文件目录 .....	68
12.2	存放地点 .....	69
12.3	查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF)	
场内简称	中信保诚 500LOF	
基金主代码	165511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	169,618,102.00 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 02 月 03 日	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中信保诚 500LOF	-
下属分级基金的交易代码	165511	013119
报告期末下属分级基金的份额总额	162,467,244.43 份	7,150,857.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 500 指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。
投资策略	<p>本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股(含存托凭证)及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:</p> <p>(1) 基本面替代:按照与被替代股票所属行业,基本面及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库;</p> <p>(2) 相关性检验:计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相</p>

	<p>关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中替代股票的权重,并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货,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将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,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析、定量分析等方式,筛选相应的存托凭证投资标的。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王小飞
	联系电话	021-68649788	021-60637103
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637228
传真		021-50120895	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		涂一锴	张金良

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
--------	----------------	------------------

### § 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 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-8,215,804.79	-376,916.11
本期利润	-12,548,662.68	-583,489.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0751	-0.0808
本期加权平均净值利润率	-5.19%	-5.64%
本期基金份额净值增长率	-5.23%	-5.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
期末可供分配利润	100,576,424.44	4,308,399.60
期末可供分配基金份额利润	0.6191	0.6025
期末基金资产净值	226,768,069.48	9,862,636.68
期末基金份额净值	1.3958	1.3792
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	-6.32%	-23.30%

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

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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
过去一个月	-5.59%	0.88%	-6.55%	0.91%	0.96%	-0.03%
过去三个月	-4.06%	1.02%	-6.16%	1.09%	2.10%	-0.07%
过去六个月	-5.23%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.23%	-0.06%

过去一年	-12.55%	1.15%	-16.71%	1.21%	4.16%	-0.06%
过去三年	-16.62%	1.11%	-26.01%	1.14%	9.39%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-6.32%	1.09%	-21.12%	1.11%	14.80%	-0.02%

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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
过去一个月	-5.62%	0.88%	-6.55%	0.91%	0.93%	-0.03%
过去三个月	-4.16%	1.02%	-6.16%	1.09%	2.00%	-0.07%
过去六个月	-5.42%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.04%	-0.06%
过去一年	-12.91%	1.15%	-16.71%	1.21%	3.80%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-23.30%	1.11%	-29.41%	1.14%	6.11%	-0.03%

### 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 500 指数 (LOF) A



中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，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，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 84 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、中信保诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智慧金货币市场基金、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、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、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。

#### 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		
黄稚	基金经理	2018 年 07 月 25 日	-	12	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的基金经理。
HAN YILING	量化投资部副总监、	2023 年 07 月	-	10	HAN YILING 先生，计

	基金经理	05 日		<p>计算机硕士、信息技术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术研究 院，担任研究员；于中信保诚基金管 理有限公司，担任量化投 资部金融工程师；于华 宝兴业基金管理有限 公司，担任量化部投资 经理。2016 年 6 月重 新加入中信保诚基金 管理有限公司，历任投 资经理、基金经理助 理、量化二部副总监。 现任量化投资部副总 监，中信保诚沪深 300 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 500 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 诚国企红利量化选股 股票型证券投资基金 的基金经理。</p>
--	------	------	--	---

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法 规的规定以及基金合同、招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。 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，没有发生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时需通过交易系统内的公平交易程序，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统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，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，相关情况由投资组合经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品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。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每月对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

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

回顾 2024 年上半年，海外方面，美国通胀有所缓和，但美联储降息预期反复波动，美债利率仍在高位运行。国内方面，经济继续修复，社零边际改善，外需拉动下出口表现较好，制造业韧性较强，而基建增速略有放缓，房地产投资仍然承压。房地产政策持续优化，对稳定市场预期有一定积极作用。

报告期内，A 股市场经历年初调整后反弹修复，之后总体呈现弱势震荡格局，二季度成交额有所下降，市场整体风险偏好回落。上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 指数下跌 8.96%。分行业来看，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，而计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药生物等行业跌幅较大。从风格上看，在经济总量弹性较为缺乏的

背景下，大盘和红利风格相对占优。从量化角度看，市场存量博弈格局之下，基本面因子如价值因子等表现较强。

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数。报告期内，本基金在严格控制指数跟踪偏离的基础上，采用数量化方法构建指数化投资组合，实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对投资者日常申购、赎回需求，根据市场情况、成分股停复牌等合理安排权益仓位和头寸，有效管理跟踪误差。本基金运用股指期货进行多头套保以提高投资效率，同时通过参与网下新股申购力争提高基金收益。

#### 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 500 指数 (LOF) A 份额净值增长率为-5.23%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 份额净值增长率为-5.42%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，全球通胀压力有望继续缓和，海外经济面临下行压力，美联储降息时点临近，或利于外部流动性改善和风险偏好提振。国内仍处于经济修复期，但面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战，国内政策有望继续发力，政策的实施和影响、基本面恢复有待进一步观察。随着外部环境缓和、内生动能逐步恢复，预计国内经济将延续企稳回升态势。

随着经济预期改善、资本市场制度不断完善，投资者信心也将逐渐恢复，A 股市场也有望逐步企稳。整体来看，经过震荡回调后目前 A 股估值水平处于历史较低水平，权益资产具备较好的配置性价比。新质生产力、高端制造和国企改革等结构性投资机会可能进一步增加。

#### 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决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、海外投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。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。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，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

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，确定证券投资基金的份额净值，

托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金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

本托管人复核审查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。

### § 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 500 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日:2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	13,916,623.48	14,867,266.43
结算备付金		523,092.66	166,745.89
存出保证金		11,968.00	18,630.82
交易性金融资产	6.4.7.2	222,973,142.51	241,764,553.95
其中：股票投资		222,951,140.87	241,756,653.71
基金投资		-	-
债券投资		22,001.64	7,900.24
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		-	1,125,726.66
应收股利		-	-
应收申购款		174,328.91	349,262.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		237,599,155.56	258,292,186.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> <b>2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		0.31	665,691.00
应付赎回款		306,088.21	361,824.95
应付管理人报酬		202,022.66	217,707.18
应付托管费		40,404.56	43,541.45
应付销售服务费		3,319.81	3,553.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	416,613.84	609,732.82
负债合计		968,449.40	1,902,051.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	131,745,882.12	135,271,158.48
未分配利润	6.4.7.8	104,884,824.04	121,118,976.86



净资产合计		236,630,706.16	256,390,135.34
负债和净资产总计		237,599,155.56	258,292,186.68

注：截止本报告期末，基金份额总额 169,618,102.00 份。其中：中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 的基金份额净值 1.3958 元，基金份额总额 162,467,244.43 份；中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 的基金份额净值 1.3792 元，基金份额总额 7,150,857.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-11,415,158.77	11,890,249.24
1. 利息收入		28,884.09	34,427.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,884.09	34,427.15
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）		-6,926,099.02	-5,752,784.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,152,851.17	-8,660,569.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,555.99	34,991.03
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	55,942.14	3,086.03
股利收益	6.4.7.14	3,153,254.02	2,869,708.00
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	-4,539,431.52	17,570,159.82
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	21,487.68	38,446.89
<b>减：二、营业总支出</b>		1,716,993.65	1,830,432.67
1. 管理人报酬		1,255,173.79	1,309,784.14
2. 托管费		251,034.74	288,152.47
3. 销售服务费		20,628.87	37,880.48
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		201.64	11.67

8. 其他费用	6.4.7.18	189,954.61	194,603.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,132,152.42	10,059,816.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,132,152.42	10,059,816.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,132,152.42	10,059,816.57

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	135,271,158.48	121,118,976.86	256,390,135.34
二、本期期初净资产	135,271,158.48	121,118,976.86	256,390,135.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,525,276.36	-16,234,152.82	-19,759,429.18
（一）、综合收益总额	-	-13,132,152.42	-13,132,152.42
（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）	-3,525,276.36	-3,102,000.40	-6,627,276.76
其中：1. 基金申购款	14,817,710.97	12,490,016.25	27,307,727.22
2. 基金赎回款	-18,342,987.33	-15,592,016.65	-33,935,003.98
（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	131,745,882.12	104,884,824.04	236,630,706.16
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	128,237,979.99	125,286,668.04	253,524,648.03
二、本期期初净资产	128,237,979.99	125,286,668.04	253,524,648.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,891,091.42	7,862,254.86	5,971,163.44
（一）、综合收益总额	-	10,059,816.57	10,059,816.57
（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）	-1,891,091.42	-2,197,561.71	-4,088,653.13
其中：1. 基金申购款	27,540,509.43	29,898,427.96	57,438,937.39
2. 基金赎回款	-29,431,600.85	-32,095,989.67	-61,527,590.52
（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）	-	-	-

“-”号填列)			
四、本期期末净资产	126,346,888.57	133,148,922.90	259,495,811.47

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

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (原“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”) (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”) 《关于核准信诚中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》 (证监许可[2010]1877 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》及其配套规则和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2011 年 2 月 11 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集资金总额人民币 374,254,300.10 元。上述募集资金已由会计师事务所验证, 并出具了验资报告。经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上字[2011]第 76 号文审核同意, 本基金信诚 500A 份额 10,134,545.00 份及信诚 500B 为 15,201,819.00 份基金份额于 2011 年 3 月 14 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》和《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告》, 本基金于 2020 年 12 月 31 日终止分级运作, 《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日, 对在该日登记在册的信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额办理向场内信诚中证 500 份额折算。于 2021 年 1 月 1 日, 《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 基金名称由“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)”, 取消分级机制, 基金规模为 133,346,991.28 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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》, 经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准, 公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”, 并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据基金管理人中信保诚基金管理有限公司 2021 年 8 月 26 日《中信保诚基金管理有限公司关

于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，自 2021 年 8 月 26 日起本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同，将本基金的基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用。在本基金的基金份额分类实施后，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

#### 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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、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。

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

d) 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。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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 2024 年 06 月 30 日
活期存款	13,916,623.48
等于：本金	13,915,376.32
加：应计利息	1,247.16
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	13,916,623.48

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	245,267,181.81	-	222,951,140.87	-22,316,040.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	22,000.00	1.64	22,001.64
	银行间市场	-	-	-
	合计	22,000.00	1.64	22,001.64
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	245,289,181.81	1.64	222,973,142.51	-22,316,040.94

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	398.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	276,657.45
其中：交易所市场	276,657.45
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	29,835.26

应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	50,050.00
合计	416,613.84

#### 6.4.7.7 实收基金

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	166,908,208.25	129,640,929.17
本期申购	16,670,528.52	12,948,365.19
本期赎回 (以“-”号填列)	-21,111,492.34	-16,397,649.32
本期末	162,467,244.43	126,191,645.04

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	7,248,701.53	5,630,229.31
本期申购	2,406,704.22	1,869,345.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,504,548.18	-1,945,338.01
本期末	7,150,857.57	5,554,237.08

注：1、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)。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

基金代码	基金名称	本报告期末		上年度末	
		场内	场外	场内	场外
165511	中信保诚中证500指数(LOF)A	13,853,893.00	145,613,551.43	14,251,963.00	152,526,245.25
013119	中信保诚中证500指数(LOF)C	-	7,150,857.57	-	7,248,701.53

#### 6.4.7.8 未分配利润

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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	119,549,223.07	-3,370,164.97	116,179,058.10
本期期初	119,549,223.07	-3,370,164.97	116,179,058.10
本期利润	-8,215,804.79	-4,332,857.89	-12,548,662.68
本期基金份额交易产生的变动数	-2,931,617.52	-122,353.46	-3,053,970.98
其中：基金申购款	11,501,533.03	-544,125.67	10,957,407.36
基金赎回款	-14,433,150.55	421,772.21	-14,011,378.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,401,800.76	-7,825,376.32	100,576,424.44

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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	5,082,005.75	-142,086.99	4,939,918.76
本期期初	5,082,005.75	-142,086.99	4,939,918.76
本期利润	-376,916.11	-206,573.63	-583,489.74
本期基金份额交易产生的变动数	-58,948.27	10,918.85	-48,029.42
其中：基金申购款	1,630,475.30	-97,866.41	1,532,608.89
基金赎回款	-1,689,423.57	108,785.26	-1,580,638.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,646,141.37	-337,741.77	4,308,399.60

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	26,724.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,061.31
其他	98.22
合计	28,884.09

注：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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	208,596,333.34
减：卖出股票成本总额	218,248,445.48
减：交易费用	500,739.03
买卖股票差价收入	-10,152,851.17

#### 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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益—利息收入	9.86
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	17,546.13

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	17,555.99

#### 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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	75,457.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,900.00
减：应计利息总额	8.72
减：交易费用	3.03
买卖债券差价收入	17,546.13

#### 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
	2024年01月01日至2024年06月30日
股指期货投资收益	55,942.14

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,153,254.02
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	3,153,254.02

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,539,431.52
--股票投资	-4,539,431.52
--债券投资	-
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,539,431.52

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	21,480.39
转换费收入	7.29
合计	21,487.68

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	82.01

银行费用	265.00
指数使用费	100,100.00
合计	189,954.61

#### 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

截至本财务报告批准报出日，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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,255,173.79	1,309,784.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	454,041.87	503,112.39
应支付基金管理人的净管理费	801,131.92	806,671.75

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	251,034.74	288,152.47

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/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		
	2024年01月01日至2024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 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023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 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	合计
中信保诚基金管理有限公司	-	17,118.33	17,118.33
合计	-	17,118.33	17,118.33

注：本基金中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 的销售服务费按前一日中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算公式为：中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 基金日销售服务费=中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 基金份额前一日资产净值×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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
中国建设银	13,916,623.48	26,724.56	17,288,117.29	30,238.57

行股份有限公司				
---------	--	--	--	--

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设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 2024 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
001359	平安电工	2024年03月19日	6个月	锁定期股票	17.39	20.60	137	2,382.43	2,822.20	-
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	锁定期股票	16.98	13.48	141	2,394.18	1,900.68	-
001387	雪祺电气	2024年01月04日	6个月	锁定期股票	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年06月03日	1-6个月(含)	锁定期股票-转增	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024年03月26日	6个月	锁定期股票	17.43	34.56	178	3,102.54	6,151.68	-
30139	汇成	2024年	6个月	锁定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

2	真空	05 月 28 日		股票							
301502	华阳智能	2024 年 01 月 26 日	6 个月	锁定期股票	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-	
301536	星辰科技	2024 年 03 月 20 日	6 个月	锁定期股票	16.16	32.27	377	6,092.32	12,165.79	-	
301538	骏鼎达	2024 年 03 月 13 日	6 个月	锁定期股票	55.82	91.24	101	5,637.82	9,215.24	-	
301538	骏鼎达	2024 年 05 月 22 日	1-6 个月(含)	锁定期股票-转增	-	91.24	40	-	3,649.60	-	
301539	宏鑫科技	2024 年 04 月 03 日	6 个月	锁定期股票	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024 年 06 月 13 日	6 个月	锁定期股票	11.88	18.98	473	5,619.24	8,977.54	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	锁定期股票	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024 年 06 月 19 日	6 个月	锁定期股票	44.95	65.93	113	5,079.35	7,450.09	-	
301587	中瑞股份	2024 年 03 月 27 日	6 个月	锁定期股票	21.73	25.26	257	5,584.61	6,491.82	-	
301588	美新科技	2024 年 03 月 06 日	6 个月	锁定期股票	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301591	肯特股份	2024 年 02 月 20 日	6 个月	锁定期股票	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
603082	北自科技	2024 年 01 月 23 日	6 个月	锁定期股票	21.28	29.49	91	1,936.48	2,683.59	-	
603285	键邦股份	2024 年 06 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	897	16,729.05	16,729.05	-	
603285	键邦股份	2024 年 06 月 28 日	6 个月	锁定期股票	18.65	18.65	100	1,865.00	1,865.00	-	



		日								
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	锁定期股票	29.02	25.36	68	1,973.36	1,724.48	-
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	锁定期股票	72.46	68.06	32	2,318.72	2,177.92	-
603341	龙旗科技	2024年02月23日	6个月	锁定期股票	26.00	37.49	109	2,834.00	4,086.41	-
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	锁定期股票	19.18	22.66	121	2,320.78	2,741.86	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	锁定期股票	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年01月17日	6个月	锁定期股票	38.18	38.90	53	2,023.54	2,061.70	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	锁定期股票	23.35	25.13	87	2,031.45	2,186.31	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	锁定期股票	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	6个月	锁定期股票	22.66	15.89	284	6,435.44	4,512.76	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	锁定期股票	19.86	42.51	238	4,726.68	10,117.38	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	锁定期股票	86.96	174.93	74	6,435.04	12,944.82	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	锁定期股票	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	锁定期股票	15.69	18.79	342	5,365.98	6,426.18	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024 年 06 月 17 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	220	22,000.00	22,001.64	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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（及其下设的风控与审计委员会）、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。董事会下设风控与审计委员会，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 and 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

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险等情况。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，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。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。另外，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。

##### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	22,001.64	7,900.24
未评级	-	-
合计	22,001.64	7,900.24

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。

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同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基

金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024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	13,916,623.48	-	-	-	-	-	13,916,623.48
结算备付金	523,092.66	-	-	-	-	-	523,092.66
存出保证金	11,968.00	-	-	-	-	-	11,968.00
交易性金融资产	-	-	-	-	22,001,644	222,951,140.87	222,973,142.51
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	-	-	-	-	-	174,328.91	174,328.91
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,451,684.14	-	-	-	22,001,644	223,125,469.78	237,599,155.56
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	-	-	-	-	-	0.31	0.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	306,088.21	306,088.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	202,022.66	202,022.66
应付托管费	-	-	-	-	-	40,404.56	40,404.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,319.81	3,319.81
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	416,613.84	416,613.84
负债总计	-	-	-	-	-	968,449.40	968,449.40
利率敏感度缺口	14,451,684.14	-	-	-	22,001.64	222,157,020.38	236,630,706.16
上年度末 2023 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	14,867,266.43	-	-	-	-	-	14,867,266.43
结算备付金	166,745.89	-	-	-	-	-	166,745.89
存出保证金	18,630.82	-	-	-	-	-	18,630.82
交易性金融资产	-	-	-	-	7,900.24	241,756,653.71	241,764,553.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,125,726.66	1,125,726.66
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	349,262.93	349,262.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,052,643.14	-	-	-	7,900.24	243,231,643.30	258,292,186.68
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	-	-	-	-	-	665,691.00	665,691.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	361,824.95	361,824.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	217,707.18	217,707.18
应付托管费	-	-	-	-	-	43,541.45	43,541.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,553.94	3,553.94

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	609,732.82	609,732.82
负债总计	-	-	-	-	1,902,051.34	1,902,051.34
利率敏感度缺口	15,052,643.14	-	-	-	7,900.24	241,329,591.96

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，并按照合同约定规定的利率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

于本报告期末及上年度末，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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

##### 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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	222,951,140.8	94.22	241,756,653.7	94.29



	7		1	
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	222,951,140.87	94.22	241,756,653.71	94.29

#### 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(2024年06月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	10,825,391.10	11,416,359.60
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-10,825,391.10	-11,416,359.60	

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	222,741,571.57	241,138,232.44
第二层次	62,204.25	7,900.24
第三层次	169,366.69	618,421.27
合计	222,973,142.51	241,764,553.95

###### 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券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	222,951,140.87	93.83
	其中：股票	222,951,140.87	93.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,001.64	0.01
	其中：债券	22,001.64	0.01
	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	14,439,716.14	6.08
8	其他各项资产	186,296.91	0.08
9	合计	237,599,155.56	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	1,157,399.88	0.49
B	采矿业	10,127,234.00	4.28
C	制造业	141,419,054.63	59.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,340,037.20	4.37
E	建筑业	2,622,262.00	1.11
F	批发和零售业	3,885,846.04	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	5,502,726.00	2.33
H	住宿和餐饮业	917,179.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,227,197.43	6.01
J	金融业	20,057,813.40	8.48
K	房地产业	2,889,301.00	1.22
L	租赁和商务服务业	1,024,531.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,603,145.28	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	1,138,149.35	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	148,716.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,360,062.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	4,073,813.36	1.72
S	综合	247,104.00	0.10
	合计	222,741,571.57	94.13

### 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	180,638.80	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,930.50	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,569.30	0.09

### 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	300502	新易盛	21,200	2,237,660.00	0.95
2	002028	思源电气	21,700	1,451,730.00	0.61
3	601058	赛轮轮胎	98,800	1,383,200.00	0.58
4	601233	桐昆股份	75,500	1,204,980.00	0.51
5	000423	东阿阿胶	18,800	1,176,880.00	0.50
6	601567	三星医疗	32,900	1,151,500.00	0.49
7	600157	永泰能源	968,400	1,142,712.00	0.48
8	601128	常熟银行	145,840	1,104,008.80	0.47
9	002532	天山铝业	134,900	1,094,039.00	0.46
10	002128	电投能源	51,300	1,082,430.00	0.46
11	002078	太阳纸业	76,700	1,069,965.00	0.45
12	002138	顺络电子	38,800	1,065,448.00	0.45
13	600398	海澜之家	113,700	1,050,588.00	0.44
14	600885	宏发股份	37,920	1,049,625.60	0.44
15	300207	欣旺达	68,800	1,043,696.00	0.44
16	002185	华天科技	124,500	1,014,675.00	0.43
17	300136	信维通信	51,500	1,008,370.00	0.43
18	688617	惠泰医疗	2,201	1,003,876.10	0.42
19	603606	东方电缆	20,400	995,724.00	0.42
20	603979	金诚信	19,600	990,388.00	0.42
21	002517	恺英网络	103,200	985,560.00	0.42
22	688099	晶晨股份	16,586	983,881.52	0.42
23	002738	中矿资源	35,940	963,192.00	0.41
24	002465	海格通信	92,900	962,444.00	0.41
25	000683	远兴能源	138,000	953,580.00	0.40
26	600642	申能股份	107,500	949,225.00	0.40
27	002008	大族激光	45,600	948,480.00	0.40
28	688120	华海清科	5,000	947,900.00	0.40
29	601577	长沙银行	115,700	946,426.00	0.40

30	002739	万达电影	78,000	943,020.00	0.40
31	601000	唐山港	200,500	942,350.00	0.40
32	002444	巨星科技	38,000	938,600.00	0.40
33	600529	山东药玻	37,000	937,580.00	0.40
34	000039	中集集团	100,870	934,056.20	0.39
35	000703	恒逸石化	130,700	926,663.00	0.39
36	601990	南京证券	119,100	914,688.00	0.39
37	002595	豪迈科技	23,900	912,263.00	0.39
38	688169	石头科技	2,319	910,439.40	0.38
39	603228	景旺电子	28,512	906,681.60	0.38
40	000738	航发控制	44,900	901,143.00	0.38
41	600521	华海药业	52,500	895,125.00	0.38
42	603816	顾家家居	27,700	894,433.00	0.38
43	000933	神火股份	44,200	894,166.00	0.38
44	601615	明阳智能	94,600	893,024.00	0.38
45	601717	郑煤机	60,159	890,353.20	0.38
46	601198	东兴证券	110,700	881,172.00	0.37
47	002262	恩华药业	37,100	880,754.00	0.37
48	300866	安克创新	12,360	880,155.60	0.37
49	600839	四川长虹	195,900	879,591.00	0.37
50	600549	厦门钨业	50,600	872,850.00	0.37
51	002064	华峰化学	121,300	869,721.00	0.37
52	600862	中航高科	46,300	869,514.00	0.37
53	603589	口子窖	22,100	866,099.00	0.37
54	000728	国元证券	142,900	865,974.00	0.37
55	002294	信立泰	32,500	865,475.00	0.37
56	300285	国瓷材料	48,300	862,155.00	0.36
57	688188	柏楚电子	4,668	861,479.40	0.36
58	600369	西南证券	240,500	860,990.00	0.36
59	601966	玲珑轮胎	46,600	856,042.00	0.36
60	002195	岩山科技	340,260	854,052.60	0.36
61	300699	光威复材	34,380	853,655.40	0.36
62	600282	南钢股份	170,600	849,588.00	0.36
63	300001	特锐德	42,200	849,064.00	0.36
64	300529	健帆生物	31,200	848,952.00	0.36
65	000883	湖北能源	141,200	848,612.00	0.36
66	000830	鲁西化工	73,200	848,388.00	0.36
67	600985	淮北矿业	50,400	843,696.00	0.36
68	002152	广电运通	80,400	840,984.00	0.36
69	300037	新宙邦	29,300	836,808.00	0.35
70	000513	丽珠集团	22,450	835,364.50	0.35

71	002958	青农商行	311,400	834,552.00	0.35
72	600582	天地科技	120,700	831,623.00	0.35
73	600141	兴发集团	43,500	829,980.00	0.35
74	601216	君正集团	223,400	824,346.00	0.35
75	000921	海信家电	25,500	822,120.00	0.35
76	002025	航天电器	17,700	820,926.00	0.35
77	603179	新泉股份	20,900	820,116.00	0.35
78	300383	光环新网	97,000	819,650.00	0.35
79	002558	巨人网络	86,700	818,448.00	0.35
80	603225	新凤鸣	52,200	813,798.00	0.34
81	300373	扬杰科技	20,900	813,010.00	0.34
82	600872	中炬高新	35,700	810,033.00	0.34
83	601991	大唐发电	268,800	809,088.00	0.34
84	300088	长信科技	172,000	808,400.00	0.34
85	600498	烽火通信	50,700	806,130.00	0.34
86	000027	深圳能源	110,400	805,920.00	0.34
87	000598	兴蓉环境	107,100	805,392.00	0.34
88	600066	宇通客车	31,200	804,960.00	0.34
89	601231	环旭电子	50,100	804,105.00	0.34
90	600170	上海建工	373,000	801,950.00	0.34
91	601866	中远海发	310,300	800,574.00	0.34
92	600763	通策医疗	14,800	799,940.00	0.34
93	000060	中金岭南	188,500	799,240.00	0.34
94	002429	兆驰股份	164,800	792,688.00	0.33
95	603298	杭叉集团	40,300	791,492.00	0.33
96	300251	光线传媒	94,000	790,540.00	0.33
97	600004	白云机场	83,000	786,840.00	0.33
98	600511	国药股份	25,500	785,145.00	0.33
99	002340	格林美	123,100	784,147.00	0.33
100	002756	永兴材料	21,900	783,582.00	0.33
101	603658	安图生物	17,000	783,190.00	0.33
102	600566	济川药业	24,600	780,066.00	0.33
103	002939	长城证券	116,100	777,870.00	0.33
104	601958	金钼股份	74,200	772,422.00	0.33
105	603927	中科软	42,604	770,706.36	0.33
106	002203	海亮股份	96,500	770,070.00	0.33
107	600707	彩虹股份	112,700	767,487.00	0.32
108	603568	伟明环保	37,283	767,284.14	0.32
109	300253	卫宁健康	130,000	767,000.00	0.32
110	603156	养元饮品	35,800	761,466.00	0.32
111	300009	安科生物	88,876	759,001.04	0.32

112	000887	中鼎股份	62,000	758,880.00	0.32
113	600901	江苏金租	149,800	756,490.00	0.32
114	300487	蓝晓科技	18,050	753,768.00	0.32
115	601636	旗滨集团	116,700	752,715.00	0.32
116	600598	北大荒	60,112	750,798.88	0.32
117	300296	利亚德	163,900	737,550.00	0.31
118	002557	洽洽食品	26,000	732,940.00	0.31
119	603885	吉祥航空	66,600	731,934.00	0.31
120	600563	法拉电子	9,600	731,328.00	0.31
121	601399	国机重装	282,500	728,850.00	0.31
122	000563	陕国投 A	264,600	727,650.00	0.31
123	600399	抚顺特钢	129,000	726,270.00	0.31
124	002487	大金重工	31,700	725,296.00	0.31
125	300748	金力永磁	55,660	721,353.60	0.30
126	002936	郑州银行	412,730	714,022.90	0.30
127	601098	中南传媒	56,908	706,797.36	0.30
128	600517	国网英大	162,800	704,924.00	0.30
129	002683	广东宏大	35,000	704,550.00	0.30
130	601077	渝农商行	140,100	703,302.00	0.30
131	002423	中粮资本	93,300	698,817.00	0.30
132	300595	欧普康视	44,500	697,760.00	0.29
133	600871	石化油服	400,600	697,044.00	0.29
134	002608	江苏国信	89,500	693,625.00	0.29
135	600848	上海临港	76,100	693,271.00	0.29
136	002372	伟星新材	44,620	688,040.40	0.29
137	601019	山东出版	58,200	687,924.00	0.29
138	601965	中国汽研	40,500	684,045.00	0.29
139	000988	华工科技	22,800	682,404.00	0.29
140	000155	川能动力	63,300	681,741.00	0.29
141	000997	新大陆	49,000	681,590.00	0.29
142	600612	老凤祥	11,700	680,823.00	0.29
143	600258	首旅酒店	55,100	680,485.00	0.29
144	300394	天孚通信	7,680	679,065.60	0.29
145	000032	深桑达 A	45,300	678,594.00	0.29
146	002531	天顺风能	75,900	678,546.00	0.29
147	601168	西部矿业	37,800	678,510.00	0.29
148	300558	贝达药业	20,700	673,785.00	0.28
149	300357	我武生物	32,900	665,238.00	0.28
150	000958	电投产融	181,300	663,558.00	0.28
151	600315	上海家化	37,000	657,860.00	0.28
152	600663	陆家嘴	74,200	654,444.00	0.28

153	688029	南微医学	10,539	648,780.84	0.27
154	002384	东山精密	31,100	643,770.00	0.27
155	001872	招商港口	33,400	642,950.00	0.27
156	002202	金风科技	95,500	641,760.00	0.27
157	688475	萤石网络	18,700	637,857.00	0.27
158	603786	科博达	9,900	635,085.00	0.27
159	688349	三一重能	25,500	633,420.00	0.27
160	600928	西安银行	192,500	629,475.00	0.27
161	000630	铜陵有色	173,800	627,418.00	0.27
162	600418	江淮汽车	39,600	627,264.00	0.27
163	688778	厦钨新能	20,000	624,800.00	0.26
164	003022	联泓新科	45,500	623,805.00	0.26
165	688281	华秦科技	7,420	618,234.40	0.26
166	600988	赤峰黄金	37,700	616,018.00	0.26
167	600764	中国海防	31,000	608,530.00	0.26
168	000959	首钢股份	223,467	607,830.24	0.26
169	001203	大中矿业	62,800	603,508.00	0.26
170	603939	益丰药房	24,364	598,136.20	0.25
171	002625	光启技术	34,200	593,370.00	0.25
172	600801	华新水泥	42,760	587,950.00	0.25
173	688375	国博电子	8,200	579,248.00	0.24
174	688006	杭可科技	32,820	572,709.00	0.24
175	600096	云天化	29,000	563,180.00	0.24
176	601666	平煤股份	50,100	561,120.00	0.24
177	000400	许继电气	16,200	557,442.00	0.24
178	688276	百克生物	19,600	556,052.00	0.23
179	688819	天能股份	22,600	539,236.00	0.23
180	688777	中控技术	14,300	539,110.00	0.23
181	002156	通富微电	24,000	537,360.00	0.23
182	002273	水晶光电	31,440	533,851.20	0.23
183	601555	东吴证券	90,130	531,767.00	0.22
184	600208	新湖中宝	328,700	519,346.00	0.22
185	600820	隧道股份	78,600	513,258.00	0.22
186	002223	鱼跃医疗	13,650	513,240.00	0.22
187	600352	浙江龙盛	59,000	506,810.00	0.21
188	002966	苏州银行	66,430	498,225.00	0.21
189	688348	昱能科技	8,301	489,759.00	0.21
190	601108	财通证券	73,800	487,818.00	0.21
191	002353	杰瑞股份	13,900	487,612.00	0.21
192	600765	中航重机	23,460	478,584.00	0.20
193	600879	航天电子	59,700	463,869.00	0.20



194	301236	软通动力	13,000	457,730.00	0.19
195	600873	梅花生物	45,200	452,904.00	0.19
196	600177	雅戈尔	62,900	447,848.00	0.19
197	603317	天味食品	39,220	447,500.20	0.19
198	600109	国金证券	59,000	445,450.00	0.19
199	600079	人福医药	25,900	444,703.00	0.19
200	300003	乐普医疗	29,800	442,232.00	0.19
201	600060	海信视像	17,700	437,898.00	0.19
202	300017	网宿科技	55,300	436,870.00	0.18
203	600497	驰宏锌锗	80,800	431,472.00	0.18
204	603160	汇顶科技	6,200	426,250.00	0.18
205	600655	豫园股份	81,500	419,725.00	0.18
206	689009	九号公司	11,305	416,137.05	0.18
207	000932	华菱钢铁	93,600	414,648.00	0.18
208	003031	中瓷电子	8,900	411,536.00	0.17
209	002409	雅克科技	6,500	408,915.00	0.17
210	600536	中国软件	13,628	407,749.76	0.17
211	600348	华阳股份	40,800	406,368.00	0.17
212	002281	光迅科技	10,800	403,596.00	0.17
213	000009	中国宝安	46,700	401,620.00	0.17
214	000878	云南铜业	31,800	396,228.00	0.17
215	002436	兴森科技	38,300	395,256.00	0.17
216	300474	景嘉微	6,250	395,187.50	0.17
217	002797	第一创业	76,200	387,858.00	0.16
218	300054	鼎龙股份	17,000	385,560.00	0.16
219	600298	安琪酵母	13,800	385,434.00	0.16
220	300012	华测检测	38,100	383,286.00	0.16
221	000066	中国长城	43,800	383,250.00	0.16
222	002673	西部证券	60,800	376,352.00	0.16
223	002563	森马服饰	64,600	375,326.00	0.16
224	601696	中银证券	41,100	373,188.00	0.16
225	601179	中国西电	46,400	373,056.00	0.16
226	688525	佰维存储	5,800	372,070.00	0.16
227	603596	伯特利	9,560	371,884.00	0.16
228	000967	盈峰环境	87,500	370,125.00	0.16
229	000831	中国稀土	14,400	365,040.00	0.15
230	000783	长江证券	75,200	363,216.00	0.15
231	300395	菲利华	11,800	362,850.00	0.15
232	002432	九安医疗	8,900	360,806.00	0.15
233	300002	神州泰岳	44,400	360,528.00	0.15
234	688180	君实生物	12,100	351,505.00	0.15

235	601997	贵阳银行	66,300	349,401.00	0.15
236	000960	锡业股份	22,356	346,294.44	0.15
237	603338	浙江鼎力	5,700	344,394.00	0.15
238	002155	湖南黄金	19,000	343,900.00	0.15
239	601162	天风证券	157,600	343,568.00	0.15
240	600863	内蒙华电	73,900	342,896.00	0.14
241	603345	安井食品	4,600	341,826.00	0.14
242	600038	中直股份	8,300	341,213.00	0.14
243	300724	捷佳伟创	6,300	340,263.00	0.14
244	002984	森麒麟	14,000	337,260.00	0.14
245	002472	双环传动	15,300	336,906.00	0.14
246	600699	均胜电子	22,360	331,375.20	0.14
247	002407	多氟多	26,860	328,497.80	0.14
248	002850	科达利	4,300	328,434.00	0.14
249	600546	山煤国际	22,400	327,488.00	0.14
250	301358	湖南裕能	10,300	324,038.00	0.14
251	600895	张江高科	17,500	323,400.00	0.14
252	000021	深科技	21,200	320,544.00	0.14
253	300073	当升科技	9,200	315,652.00	0.13
254	600021	上海电力	31,900	315,491.00	0.13
255	603087	甘李药业	6,800	314,976.00	0.13
256	600486	扬农化工	5,550	313,297.50	0.13
257	300146	汤臣倍健	23,100	313,005.00	0.13
258	300058	蓝色光标	56,300	306,272.00	0.13
259	600704	物产中大	70,500	305,970.00	0.13
260	600153	建发股份	34,000	303,620.00	0.13
261	600155	华创云信	51,300	303,183.00	0.13
262	300114	中航电测	6,700	303,175.00	0.13
263	600637	东方明珠	49,600	301,568.00	0.13
264	688065	凯赛生物	6,600	299,574.00	0.13
265	600118	中国卫星	13,400	297,882.00	0.13
266	600583	海油工程	50,100	296,091.00	0.13
267	601156	东航物流	14,400	293,040.00	0.12
268	601665	齐鲁银行	59,500	292,145.00	0.12
269	000591	太阳能	61,800	291,078.00	0.12
270	002831	裕同科技	11,320	289,678.80	0.12
271	000623	吉林敖东	21,600	289,440.00	0.12
272	600970	中材国际	23,900	288,234.00	0.12
273	002439	启明星辰	16,600	286,516.00	0.12
274	002385	大北农	74,300	286,055.00	0.12
275	300144	宋城演艺	35,600	285,868.00	0.12

276	600380	健康元	25,400	283,718.00	0.12
277	600967	内蒙一机	39,400	283,680.00	0.12
278	605358	立昂微	12,200	282,308.00	0.12
279	000729	燕京啤酒	31,900	281,677.00	0.12
280	000723	美锦能源	58,900	280,364.00	0.12
281	600143	金发科技	42,300	279,603.00	0.12
282	000519	中兵红箭	19,000	278,730.00	0.12
283	600998	九州通	57,064	278,472.32	0.12
284	600516	方大炭素	64,100	276,271.00	0.12
285	300677	英科医疗	10,300	276,143.00	0.12
286	000636	风华高科	21,000	274,260.00	0.12
287	600392	盛和资源	31,800	274,116.00	0.12
288	300024	机器人	28,100	273,694.00	0.12
289	000818	航锦科技	12,300	271,584.00	0.11
290	600416	湘电股份	27,200	270,368.00	0.11
291	600909	华安证券	63,980	269,355.80	0.11
292	002044	美年健康	70,900	268,002.00	0.11
293	600859	王府井	22,800	267,672.00	0.11
294	600008	首创环保	99,650	267,062.00	0.11
295	000629	钒钛股份	105,200	263,000.00	0.11
296	600867	通化东宝	31,400	262,818.00	0.11
297	601016	节能风电	87,680	262,163.20	0.11
298	688213	思特威	5,400	261,900.00	0.11
299	601456	国联证券	27,000	260,280.00	0.11
300	002508	老板电器	11,600	256,360.00	0.11
301	600499	科达制造	30,400	256,272.00	0.11
302	600535	天士力	20,300	255,374.00	0.11
303	601933	永辉超市	102,700	254,696.00	0.11
304	600129	太极集团	8,800	254,496.00	0.11
305	002120	韵达股份	32,800	253,872.00	0.11
306	600580	卧龙电驱	20,800	252,720.00	0.11
307	000750	国海证券	86,450	251,569.50	0.11
308	002261	拓维信息	22,700	251,289.00	0.11
309	300568	星源材质	30,500	250,100.00	0.11
310	603000	人民网	12,500	249,875.00	0.11
311	300118	东方日升	20,600	249,260.00	0.11
312	300567	精测电子	4,400	248,644.00	0.11
313	600673	东阳光	35,100	247,104.00	0.10
314	002430	杭氧股份	11,100	246,975.00	0.10
315	600166	福田汽车	109,200	245,700.00	0.10
316	603486	科沃斯	5,200	245,336.00	0.10

317	600325	华发股份	37,530	243,945.00	0.10
318	600816	建元信托	88,800	240,648.00	0.10
319	300765	新诺威	9,500	239,685.00	0.10
320	300390	天华新能	13,900	238,802.00	0.10
321	000893	亚钾国际	14,700	237,552.00	0.10
322	300601	康泰生物	15,200	237,272.00	0.10
323	600754	锦江酒店	10,300	236,694.00	0.10
324	002926	华西证券	35,800	235,922.00	0.10
325	002624	完美世界	30,800	234,080.00	0.10
326	002653	海思科	7,600	233,320.00	0.10
327	002368	太极股份	10,339	233,144.45	0.10
328	002497	雅化集团	26,100	232,812.00	0.10
329	603290	斯达半导	2,700	232,497.00	0.10
330	600737	中粮糖业	24,200	232,078.00	0.10
331	300604	长川科技	8,500	230,945.00	0.10
332	603077	和邦生物	139,900	230,835.00	0.10
333	002299	圣农发展	16,900	230,516.00	0.10
334	002065	东华软件	50,800	229,616.00	0.10
335	002056	横店东磁	18,400	229,448.00	0.10
336	600131	国网信通	13,600	229,432.00	0.10
337	688385	复旦微电	7,300	229,074.00	0.10
338	002500	山西证券	48,710	228,937.00	0.10
339	688772	珠海冠宇	15,300	227,970.00	0.10
340	002414	高德红外	38,700	227,943.00	0.10
341	600373	中文传媒	15,300	227,052.00	0.10
342	688002	睿创微纳	8,066	225,606.02	0.10
343	300763	锦浪科技	5,400	224,856.00	0.10
344	603893	瑞芯微	3,800	224,846.00	0.10
345	002507	涪陵榨菜	18,310	224,297.50	0.09
346	688114	华大智造	4,700	222,827.00	0.09
347	601611	中国核建	27,400	221,666.00	0.09
348	603379	三美股份	5,540	216,835.60	0.09
349	688052	纳芯微	2,101	215,940.78	0.09
350	688390	固德威	3,832	215,051.84	0.09
351	600755	厦门国贸	29,900	214,383.00	0.09
352	688521	芯原股份	7,900	211,325.00	0.09
353	601880	辽港股份	171,800	211,314.00	0.09
354	600329	达仁堂	6,500	210,535.00	0.09
355	600995	南网储能	21,700	209,622.00	0.09
356	600884	杉杉股份	25,600	207,872.00	0.09
357	002506	协鑫集成	106,400	206,416.00	0.09

358	002019	亿帆医药	16,700	206,412.00	0.09
358	600968	海油发展	50,100	206,412.00	0.09
360	600390	五矿资本	50,900	206,145.00	0.09
361	300070	碧水源	49,159	205,976.21	0.09
362	600435	北方导航	23,800	205,156.00	0.09
363	002244	滨江集团	28,200	204,732.00	0.09
364	600739	辽宁成大	24,300	203,391.00	0.09
365	000050	深天马 A	27,900	203,112.00	0.09
366	600483	福能股份	17,400	202,884.00	0.09
367	601598	中国外运	35,800	201,554.00	0.09
368	002572	索菲亚	13,100	200,823.00	0.08
369	002568	百润股份	11,900	200,277.00	0.08
370	300803	指南针	5,500	200,255.00	0.08
371	002080	中材科技	15,200	196,080.00	0.08
372	300676	华大基因	5,600	196,056.00	0.08
373	001286	陕西能源	17,000	196,010.00	0.08
374	002240	盛新锂能	14,600	195,932.00	0.08
375	002373	千方科技	21,500	195,005.00	0.08
376	603712	七一二	10,500	190,995.00	0.08
377	002268	电科网安	13,400	190,682.00	0.08
378	603883	老百姓	10,344	189,915.84	0.08
379	603858	步长制药	12,500	189,375.00	0.08
380	688017	绿的谐波	2,300	188,830.00	0.08
381	000778	新兴铸管	54,200	188,616.00	0.08
382	688301	奕瑞科技	1,636	188,516.28	0.08
383	688538	和辉光电	94,123	186,363.54	0.08
384	600271	航天信息	25,200	185,472.00	0.08
385	600062	华润双鹤	9,400	184,052.00	0.08
386	600528	中铁工业	25,100	183,732.00	0.08
387	688234	天岳先进	3,900	182,988.00	0.08
388	603688	石英股份	6,150	182,101.50	0.08
389	601928	凤凰传媒	16,600	181,936.00	0.08
390	600977	中国电影	16,900	181,844.00	0.08
391	601155	新城控股	20,500	181,835.00	0.08
392	000709	河钢股份	93,600	181,584.00	0.08
393	002408	齐翔腾达	32,200	180,320.00	0.08
394	000739	普洛药业	13,282	180,236.74	0.08
395	600378	昊华科技	6,200	179,180.00	0.08
396	688005	容百科技	7,695	179,139.60	0.08
397	600959	江苏有线	67,700	178,728.00	0.08
398	603444	吉比特	1,000	178,010.00	0.08

399	601118	海南橡胶	38,700	176,085.00	0.07
400	688220	翱捷科技	4,700	176,062.00	0.07
401	688536	思瑞浦	1,800	176,058.00	0.07
402	000825	太钢不锈	51,900	175,422.00	0.07
403	603882	金城医学	6,400	174,016.00	0.07
404	603737	三棵树	4,780	173,370.60	0.07
405	688331	荣昌生物	4,000	172,800.00	0.07
406	600925	苏能股份	34,100	172,205.00	0.07
407	600056	中国医药	16,914	171,169.68	0.07
408	000987	越秀资本	34,115	169,210.40	0.07
409	600906	财达证券	29,500	169,035.00	0.07
410	603456	九洲药业	12,200	167,384.00	0.07
411	688200	华峰测控	1,800	165,150.00	0.07
412	002266	浙富控股	59,100	164,889.00	0.07
413	300212	易华录	9,780	164,597.40	0.07
414	600316	洪都航空	9,700	161,311.00	0.07
415	603529	爱玛科技	5,900	161,247.00	0.07
416	000937	冀中能源	24,000	160,800.00	0.07
417	603650	彤程新材	5,400	159,570.00	0.07
418	688567	孚能科技	16,607	159,427.20	0.07
419	688063	派能科技	3,920	155,663.20	0.07
420	001227	兰州银行	64,700	153,986.00	0.07
421	603728	鸣志电器	3,800	152,874.00	0.06
422	600098	广州发展	23,800	152,320.00	0.06
423	688297	中无人机	4,606	152,136.18	0.06
424	601298	青岛港	15,800	151,048.00	0.06
425	002607	中公教育	97,200	148,716.00	0.06
426	002670	国盛金控	17,500	148,225.00	0.06
427	688516	奥特维	3,545	148,216.45	0.06
428	600022	山东钢铁	121,100	147,742.00	0.06
429	600578	京能电力	45,500	147,420.00	0.06
430	603233	大参林	10,300	147,290.00	0.06
431	300438	鹏辉能源	8,000	146,720.00	0.06
432	688561	奇安信	6,200	146,444.00	0.06
433	000559	万向钱潮	32,600	145,396.00	0.06
434	601106	中国一重	62,100	143,451.00	0.06
435	300776	帝尔激光	3,100	142,476.00	0.06
436	600500	中化国际	40,630	141,798.70	0.06
437	600377	宁沪高速	11,200	141,120.00	0.06
438	002865	钧达股份	3,600	138,168.00	0.06
439	000785	居然之家	56,700	137,781.00	0.06

440	688032	禾迈股份	1,192	136,817.76	0.06
441	600350	山东高速	15,300	135,405.00	0.06
442	600827	百联股份	18,200	134,316.00	0.06
443	300888	稳健医疗	5,280	133,584.00	0.06
444	000537	中绿电	14,000	133,420.00	0.06
445	601568	北元集团	35,930	133,300.30	0.06
446	688425	铁建重工	36,200	133,216.00	0.06
447	002690	美亚光电	8,020	132,330.00	0.06
448	000156	华数传媒	20,900	131,252.00	0.06
449	603707	健友股份	11,021	130,929.48	0.06
450	002867	周大生	9,950	129,947.00	0.05
451	603826	坤彩科技	4,480	129,785.60	0.05
452	603517	绝味食品	8,400	129,360.00	0.05
453	601992	金隅集团	94,400	129,328.00	0.05
454	300682	朗新集团	14,800	125,948.00	0.05
455	600126	杭钢股份	30,600	125,766.00	0.05
456	603218	日月股份	11,700	120,159.00	0.05
457	688520	神州细胞	3,048	119,938.80	0.05
458	600032	浙江新能	16,400	119,392.00	0.05
459	600481	双良节能	25,400	118,618.00	0.05
460	600339	中油工程	38,000	118,560.00	0.05
461	600361	创新新材	29,400	118,482.00	0.05
462	301267	华夏眼科	5,700	118,104.00	0.05
463	600095	湘财股份	19,400	115,624.00	0.05
464	000898	鞍钢股份	54,100	114,692.00	0.05
465	603127	昭衍新药	8,564	113,644.28	0.05
466	003035	南网能源	25,800	113,520.00	0.05
467	688248	南网科技	3,800	112,594.00	0.05
468	600808	马钢股份	54,200	109,484.00	0.05
469	603056	德邦股份	8,100	106,110.00	0.04
470	002153	石基信息	18,492	105,959.16	0.04
471	603185	弘元绿能	6,200	105,958.00	0.04
472	601228	广州港	34,300	104,615.00	0.04
473	000539	粤电力 A	20,200	102,616.00	0.04
474	688779	五矿新能	21,791	100,892.33	0.04
475	000401	冀东水泥	24,200	98,252.00	0.04
476	002518	科士达	5,300	93,810.00	0.04
477	603305	旭升集团	8,400	88,704.00	0.04
478	600299	安迪苏	9,100	88,270.00	0.04
479	688172	燕东微	5,400	87,372.00	0.04
480	601139	深圳燃气	13,000	86,840.00	0.04

481	300861	美畅股份	4,300	83,205.00	0.04
482	688387	信科移动	15,500	78,120.00	0.03
483	301029	怡合达	3,900	76,674.00	0.03
484	688107	安路科技	3,000	76,260.00	0.03
485	002791	坚朗五金	2,900	75,023.00	0.03
486	600927	永安期货	6,600	73,590.00	0.03
487	688153	唯捷创芯	1,900	70,300.00	0.03
488	601858	中国科传	3,600	68,832.00	0.03
489	000031	大悦城	29,200	68,328.00	0.03
490	601828	美凯龙	24,500	62,475.00	0.03
491	002945	华林证券	6,100	60,878.00	0.03
492	600956	新天绿能	7,000	57,190.00	0.02
493	601158	重庆水务	11,200	53,760.00	0.02
494	688295	中复神鹰	2,400	48,720.00	0.02
495	301165	锐捷网络	1,500	44,760.00	0.02
496	603868	飞科电器	900	34,560.00	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	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
2	603285	键邦股份	997	18,594.05	0.01
3	688692	达梦数据	74	12,944.82	0.01
4	301538	骏鼎达	141	12,864.84	0.01
5	301536	星辰科技	377	12,165.79	0.01
6	688691	灿芯股份	238	10,117.38	0.00
7	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
8	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
9	301565	中仑新材	473	8,977.54	0.00
10	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
11	301580	爱迪特	113	7,450.09	0.00
12	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
13	301587	中瑞股份	257	6,491.82	0.00
14	688709	成都华微	342	6,426.18	0.00
15	001389	广合科技	178	6,151.68	0.00
16	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
17	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
18	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
19	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
20	688584	上海合晶	284	4,512.76	0.00
21	603341	龙旗科技	109	4,086.41	0.00



22	001359	平安电工	137	2,822.20	0.00
23	603344	星德胜	121	2,741.86	0.00
24	603082	北自科技	91	2,683.59	0.00
25	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
26	603381	永臻股份	87	2,186.31	0.00
27	603325	博隆技术	32	2,177.92	0.00
28	603375	盛景微	53	2,061.70	0.00
29	001379	腾达科技	141	1,900.68	0.00
30	603312	西典新能	68	1,724.48	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	603606	东方电缆	1,985,277.00	0.77
2	603712	七一二	1,482,039.00	0.58
3	002444	巨星科技	1,438,133.00	0.56
4	300251	光线传媒	1,402,845.00	0.55
5	600549	厦门钨业	1,344,210.00	0.52
6	600985	淮北矿业	1,272,953.00	0.50
7	000513	丽珠集团	1,261,495.00	0.49
8	600315	上海家化	1,260,447.00	0.49
9	000997	新大陆	1,256,886.00	0.49
10	600956	新天绿能	1,222,839.00	0.48
11	300136	信维通信	1,139,515.00	0.44
12	688099	晶晨股份	1,121,077.70	0.44
13	601567	三星医疗	1,106,812.00	0.43
14	002465	海格通信	1,041,985.00	0.41
15	003031	中瓷电子	1,033,640.00	0.40
16	688169	石头科技	1,018,740.35	0.40
17	601615	明阳智能	998,812.00	0.39
18	603979	金诚信	991,673.00	0.39
19	300487	蓝晓科技	991,626.00	0.39
20	002936	郑州银行	970,060.00	0.38

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	000975	银泰黄金	1,956,764.12	0.76

2	002422	科伦药业	1,950,086.65	0.76
3	600161	天坛生物	1,929,128.00	0.75
4	601179	中国西电	1,610,951.00	0.63
5	603606	东方电缆	1,588,690.00	0.62
6	688208	道通科技	1,510,355.40	0.59
7	600985	淮北矿业	1,481,147.00	0.58
8	600497	驰宏锌锗	1,457,451.00	0.57
9	000630	铜陵有色	1,418,182.00	0.55
10	300776	帝尔激光	1,401,642.60	0.55
11	601077	渝农商行	1,393,652.00	0.54
12	300418	昆仑万维	1,342,443.00	0.52
13	002463	沪电股份	1,335,544.40	0.52
14	603712	七一二	1,329,986.00	0.52
15	600970	中材国际	1,268,347.00	0.49
16	600956	新天绿能	1,249,010.00	0.49
17	600482	中国动力	1,247,519.00	0.49
18	600415	小商品城	1,206,100.00	0.47
19	600998	九州通	1,205,043.00	0.47
20	002508	老板电器	1,204,889.00	0.47

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	203,982,364.16
卖出股票收入(成交)总额	208,596,333.34

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)	22,001.64	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,001.64	0.01

## 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	113685	升 24 转债	220	22,001.64	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

基金管理人可运用股指期货，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将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，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## 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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 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，江苏常熟农村商业银行股份有限公司受到国家金融监督管理苏州监管局处罚（苏州银保监罚决字[2023]12号）；桐昆集团股份有

限公司收到中国证券监督管理委员会浙江监管局《关于对桐昆集团股份有限公司及相关责任人员采取出具警示函措施的决定》。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，常熟银行、桐昆股份属于该指数成分股，本基金采用数量化方法构建指数化投资组合对前述证券进行相应投资的，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规定的备选股票库

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	11,968.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	174,328.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,296.91

### 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	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新股未上市

2	603285	键邦股份	18,594.05	0.01	新股未上市
3	688692	达梦数据	12,944.82	0.01	锁定期股票
4	301538	骏鼎达	12,864.84	0.01	锁定期股票 (包含锁定期转增股票)
5	301536	星辰科技	12,165.79	0.01	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 500 指数 (LOF) A	33,879	4,795.51	18,130,756.99	11.16%	144,336,487.44	88.84%
中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	2,358	3,032.59	-	-	7,150,857.57	100.00%
合计	36,237	4,680.80	18,130,756.99	10.69%	151,487,345.01	89.31%

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 期末上市基金前十名持有人

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	广州市广百股份有限公司	460,843.00	3.33%
2	杨胜华	414,335.00	2.99%
3	杨晓梅	354,750.00	2.56%
4	冯建强	251,670.00	1.82%
5	朱治	225,393.00	1.63%
6	张兰芳	208,254.00	1.50%
7	孔一诺	202,381.00	1.46%
8	陈远明	190,717.00	1.38%
9	陈慧然	172,263.00	1.24%
10	吴家英	169,246.00	1.22%

### 8.3 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 500 指数 (LOF) A	48,623.30	0.03%
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	-	-
	合计	48,623.30	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。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	0
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	0
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和相关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。

### 8.5 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 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2021 年 01 月 01 日) 基金份额总额	133,346,991.28	-
本报告期期初基金份额总额	166,908,208.25	7,248,701.53
本报告期基金总申购份额	16,670,528.52	2,406,704.22

减：本报告期基金总赎回份额	21,111,492.34	2,504,548.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	162,467,244.43	7,150,857.57

## § 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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	
财通证券	2	29,013,383.24	7.05%	21,350.44	5.77%	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	31,747,810.23	7.71%	30,347.45	8.20%	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	52,542,365.09	12.77%	49,712.47	13.43%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	22,259.31	0.01%	20.84	0.01%	-
光大证券	1	60,241,557.73	14.64%	44,933.19	12.14%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	4	99,975.69	0.02%	19.55	0.01%	-
国信证券	2	55,414,437.88	13.47%	51,862.84	14.01%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	23,073,820.48	5.61%	21,594.49	5.84%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	本报告期 退租
申万宏源 证券	5	39,748.38	0.01%	7.76	0.00%	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	40,664,162.90	9.88%	38,464.86	10.39%	-



万联证券	1	-	-	-	-	-	本报告期 退租
西南证券	2	-	-	-	-	-	-
信达证券	1	68,544,653.68	16.66%	64,838.52	17.52%	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际	1	-	-	-	-	-	-
招商证券	2	50,116,579.59	12.18%	46,903.72	12.67%	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融	2	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券	2	-	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-	本报告期 退租
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 10.7.2 基金租用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
财通证 券	8,663.14	5.87%	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	42,000.00	28.48%	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	16,394.32	11.12%	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	58,400.42	39.60%	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	22,000.00	14.92%	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

## 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 500 指数型证券投资基金	《中国证券报》及/或基	2024年01月19日

	(LOF) 2023 年第 4 季度报告	金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	同上	2024年01月19日
3	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2023 年年度报告	同上	2024年03月28日
4	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	同上	2024年03月28日
5	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2024 年第 1 季度报告	同上	2024年04月19日
6	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	同上	2024年04月19日
7	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2024年06月28日
8	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2024年06月28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、(原)信诚中证 500 指数分级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 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2024 年 08 月 29 日