

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	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）	16
6.1	资产负债表	16
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	41
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	43
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	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	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	61
§ 9	开放式基金份额变动	61
§ 10	重大事件揭示	62
10.1	基金份额持有人大会决议	62
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8	其他重大事件	67
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
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	68
12.3	查阅方式	68

§ 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	145,158,908.74 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	87,173,326.86 份	57,985,581.88 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	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%。 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。 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: (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; (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

	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。 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。 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。 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。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
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）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 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（2026 年 01 月 01 日至 2026 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	22,962,674.81	14,377,472.41
本期利润	42,219,393.97	25,950,268.99
加权平均基金份额本期利润	0.4607	0.4456
本期加权平均净值利润率	20.13%	19.83%
本期基金份额净值增长率	22.11%	21.87%
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 500 指数（LOF） A	中信保诚中证 500 指数（LOF） C
期末可供分配利润	103,301,050.88	66,337,763.54
期末可供分配基金份额利润	1.1850	1.1440
期末基金资产净值	219,888,454.24	143,382,637.40
期末基金份额净值	2.5224	2.4727
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 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	69.29%	37.51%

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
过去三个月	19.49%	1.55%	17.61%	1.56%	1.88%	-0.01%
过去六个月	22.11%	1.56%	19.93%	1.58%	2.18%	-0.02%
过去一年	52.60%	1.33%	49.68%	1.35%	2.92%	-0.02%
过去三年	58.03%	1.37%	48.15%	1.41%	9.88%	-0.04%
过去五年	50.68%	1.26%	31.61%	1.30%	19.07%	-0.04%

自基金合同生效起至今	69.29%	1.24%	40.31%	1.27%	28.98%	-0.03%
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
过去三个月	19.37%	1.55%	17.61%	1.56%	1.76%	-0.01%
过去六个月	21.87%	1.56%	19.93%	1.58%	1.94%	-0.02%
过去一年	52.00%	1.33%	49.68%	1.35%	2.32%	-0.02%
过去三年	56.13%	1.37%	48.15%	1.41%	7.98%	-0.04%
自基金合同生效起至今	37.51%	1.27%	25.56%	1.30%	11.95%	-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）C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中的基金为 95 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券

投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证建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		
黄稚	量化投资部助理总 监、基金经理	2018 年 07 月 25 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。
HAN YILING	量化投资部副总监、基金经理	2023 年 07 月 05 日	2026 年 01 月 21 日	12	HAN YILING 先生，经济学博士。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、量化投资部副总监、基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券，满足条件时自动执行交易系统内的公平交易程序，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

回顾 2026 年上半年，国内外宏观环境复杂多变。海外方面，一季度中东地缘冲突激化并持续发酵，二季度地缘局势有所缓和，国际能源价格大幅上涨后有所回落。美国经济延续 K 型分化格局，美联储上半年维持联邦基金利率目标区间不变，年内降息预期大幅降温，美元指数震荡走强。国内方面，经济总体保持平稳运行，上半年 GDP 同比增长 4.7%，价格端呈现企稳回暖趋势。外需韧性持续较强，但内生增长动能仍偏弱。固定资产投资同比增速由正转负，其中房地产影响较为明显；社会消费品零售总额增速有所放缓。

2026 年上半年，A 股市场呈现震荡格局，结构分化显著。报告期内，上证指数上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%。从行业上看，受益于人工智能产业发展和资本开支扩张，电子、通信等行业涨幅居前，而商贸零售、农林牧渔、美容护理等行业表现较弱。

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。基金管理人认真应对投资者日

常申购、赎回需求，根据市场情况、成分股停牌等合理安排权益仓位和头寸，有效管理跟踪误差。本基金通过参与网下新股申购，力争获取收益增厚的机会。

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 22.11%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；中信保诚中证 500 指数（LOF）C 份额净值增长率为 21.87%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度国内 GDP 增速较一季度有所回落，经济面临短期下行压力。当前内需动能仍偏弱，预计年内货币政策将延续适度宽松，存量政策有望加速落地，全年经济增长仍有较大概率实现目标。随着国内资产价格企稳回升，经济基本面与企业盈利有望逐步修复。后续仍需跟踪海外地缘风险、全球货币政策走向，以及国内政策出台和实施的节奏、力度与效果。

今年 A 股市场核心逻辑从估值提升逐步转向盈利驱动。上半年市场由景气投资主导，AI 硬科技产业链成为市场主线，资金流向有业绩兑现确定性较强的科技上游环节。展望后市，外部环境不确定性仍存，市场风险偏好可能持续受到扰动。随着行情扩散与板块轮动，市场风格上可能更加趋于均衡。市场主要外部风险或来自美联储因通胀担忧而收紧流动性。科技成长板块在经历上半年大幅上涨后，已经定价了较多的乐观预期，部分人工智能相关标的交易拥挤度上升，需警惕板块极致分化后市场短期波动加大的风险。后续需关注人工智能产业的商业化进展，若业绩兑现不及预期，板块可能面临估值回调压力。

红利风格虽阶段性表现弱势，但红利资产长期投资逻辑并未改变。上市公司分红监管不断强化，政策鼓励上市公司增加分红频次、优化分红节奏、合理提高分红比例。近年来，A 股上市公司的现金分红总额逐年上升。经过二季度的回调，红利资产的配置价值有所回升。对长期资金而言，红利资产可能已重新回到性价比较高的中长期配置区间。下半年红利资产有望迎来结构性修复，其中盈利确定性高、分红持续性强、估值合理的红利资产或将受到资金青睐。

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，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：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	21,623,645.68	19,256,306.84
结算备付金		10,991.24	99,489.04
存出保证金		9,934.57	13,037.75
交易性金融资产	6.4.7.2	343,794,019.51	305,912,411.09
其中：股票投资		343,671,016.31	305,878,410.57
基金投资		—	—
债券投资		123,003.20	34,000.52
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		43,240.85	130,916.43
应收股利		—	—
应收申购款		207,438.05	226,464.96
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		365,689,269.90	325,638,626.11
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		491,558.82	652.63
应付赎回款		1,450,099.77	1,654,706.80
应付管理人报酬		280,973.75	268,253.22
应付托管费		56,194.74	53,650.67
应付销售服务费		44,176.32	5,455.81
应付投资顾问费		—	—
应交税费		0.02	—
应付利润		—	—

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	95,174.84	188,711.49
负债合计		2,418,178.26	2,171,430.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	112,748,064.53	122,443,901.34
未分配利润	6.4.7.8	250,523,027.11	201,023,294.15
净资产合计		363,271,091.64	323,467,195.49
负债和净资产总计		365,689,269.90	325,638,626.11

注：截止本报告期末，基金份额总额 145,158,908.74 份。其中：中信保诚中证 500 指数（LOF）A 的基金份额净值 2.5224 元，基金份额总额 87,173,326.86 份；中信保诚中证 500 指数（LOF）C 的基金份额净值 2.4727 元，基金份额总额 57,985,581.88 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		70,524,951.68	13,148,720.47
1. 利息收入		34,982.39	31,303.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,982.39	31,303.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,631,519.66	6,394,731.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	37,439,300.46	3,323,902.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	59,877.76	29,462.76
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	-	27,313.03
股利收益	6.4.7.14	2,132,341.44	3,014,053.36
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	30,829,515.74	6,701,540.20
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	28,933.89	21,144.85
减：二、营业总支出		2,355,288.72	2,061,483.03
1. 管理人报酬		1,687,071.77	1,582,074.38
2. 托管费		337,414.28	316,414.87

3. 销售服务费		259,096.01	29,845.97
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		-	98.60
8. 其他费用	6.4.7.18	71,706.66	133,049.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,169,662.96	11,087,237.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,169,662.96	11,087,237.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,169,662.96	11,087,237.44

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：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	122,443,901.34	201,023,294.15	323,467,195.49
二、本期期初净资产	122,443,901.34	201,023,294.15	323,467,195.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,695,836.81	49,499,732.96	39,803,896.15
（一）、综合收益总额	-	68,169,662.96	68,169,662.96
（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）	-9,695,836.81	-18,669,930.00	-28,365,766.81
其中：1. 基金申购款	15,054,292.15	29,053,772.16	44,108,064.31
2. 基金赎回款	-24,750,128.96	-47,723,702.16	-72,473,831.12
（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	112,748,064.53	250,523,027.11	363,271,091.64
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	160,848,339.44	169,842,891.37	330,691,230.81
二、本期期初净资产	160,848,339.44	169,842,891.37	330,691,230.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,887,101.76	-899,284.32	-11,786,386.08
（一）、综合收益总额	-	11,087,237.44	11,087,237.44

(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)	-10,887,101.76	-11,986,521.76	-22,873,623.52
其中: 1. 基金申购款	12,346,792.06	12,716,503.88	25,063,295.94
2. 基金赎回款	-23,233,893.82	-24,703,025.64	-47,936,919.46
(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	149,961,237.68	168,943,607.05	318,904,844.73

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业

协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照

3%的规定征收率计算缴纳增值税。

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

b) 对本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,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

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

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

d) 本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	21,623,645.68
等于: 本金	21,621,773.35
加: 应计利息	1,872.33
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	21,623,645.68

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		259,672,196.29	—	343,671,016.31	83,998,820.02
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	123,000.00	3.20	123,003.20	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	123,000.00	3.20	123,003.20	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		259,795,196.29	3.20	343,794,019.51	83,998,820.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	504.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,262.23
其中：交易所市场	23,262.23
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	11,900.75
应付信息披露费	59,507.37
合计	95,174.84

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 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	98,561,099.99	76,554,130.47
本期申购	11,367,212.84	8,829,104.85
本期赎回（以“-”号填列）	-22,754,985.97	-17,674,200.53
本期末	87,173,326.86	67,709,034.79

中信保诚中证 500 指数（LOF）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	59,080,858.92	45,889,770.87
本期申购	8,014,644.48	6,225,187.30
本期赎回（以“-”号填列）	-9,109,921.52	-7,075,928.43
本期末	57,985,581.88	45,039,029.74

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：

单位：份

		本报告期末		上年度末	
基金代码	基金名称	场内	场外	场内	场外
155511	中信保诚中证500指数（LOF）A	9,493,277.00	77,680,049.85	11,021,744.00	87,539,355.99
013119	中信保诚中证500指数（LOF）C	-	57,985,581.88	-	59,080,858.92

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	91,418,812.71	35,620,798.03	127,039,610.74
本期期初	91,418,812.71	35,620,798.03	127,039,610.74
本期利润	22,962,674.81	19,256,719.16	42,219,393.97
本期基金份额交易产生的变动数	-11,080,436.64	-5,999,148.62	-17,079,585.26
其中：基金申购款	11,149,709.36	6,054,088.34	17,203,797.70
基金赎回款	-22,230,146.00	-12,053,236.96	-34,283,382.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	103,301,050.88	48,878,368.57	152,179,419.45

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	52,934,986.38	21,048,697.03	73,983,683.41
本期期初	52,934,986.38	21,048,697.03	73,983,683.41
本期利润	14,377,472.41	11,572,796.58	25,950,268.99
本期基金份额交易产生的变动数	-974,695.25	-615,649.49	-1,590,344.74
其中：基金申购款	7,659,785.11	4,190,189.35	11,849,974.46
基金赎回款	-8,634,480.36	-4,805,838.84	-13,440,319.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,337,763.54	32,005,844.12	98,343,607.66

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	34,826.76
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	132.58
其他	23.05
合计	34,982.39

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
----	--

卖出股票成交总额	85,815,583.78
减：卖出股票成本总额	48,297,125.45
减：交易费用	79,157.87
买卖股票差价收入	37,439,300.46

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益—利息收入	6.38
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	59,871.38
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	59,877.76

6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	125,980.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	66,100.00
减：应计利息总额	3.72
减：交易费用	5.04
买卖债券差价收入	59,871.38

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

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	2,132,341.44
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	2,132,341.44

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	30,829,515.74
--股票投资	30,829,515.74
--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	-
--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	30,829,515.74

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	28,467.24
转换费收入	466.65
合计	28,933.89

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
存托服务费	88.54
银行费用	210.00
合计	71,706.66

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、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 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,687,071.77	1,582,074.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	434,835.88	433,195.20
应支付基金管理人的净管理费	1,252,235.89	1,148,879.18

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 1.00%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×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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	337,414.28	316,414.87

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。其计算公式为：

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 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 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	-	234,913.68	234,913.68
合计	-	234,913.68	234,913.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 500 指数（LOF）A	中信保诚中证 500 指数（LOF）C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

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：

$C \text{ 类基金份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	21,623,645.68	34,826.76	19,446,724.18	30,495.65

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（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	150	7,989.00	8,811.00	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	7.82	20.74	1,411	11,034.02	29,264.14	-

001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	锁定期股票	18.38	16.78	123	2,260.74	2,063.94	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	锁定期股票	27.19	31.31	372	10,114.68	11,647.32	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	锁定期股票	30.38	38.99	263	7,989.94	10,254.37	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	10.12	27.73	1,823	18,448.76	50,551.79	-
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	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	锁定期股票	46.08	463.33	514	23,685.12	238,151.62	-
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	115	6,670.00	12,898.40	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期股票	69.66	160.06	332	23,127.12	53,139.92	-
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	213	5,256.84	18,488.40	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	330	3,689.40	5,804.70	-
60328	林平	2026 年	6 个月	锁定期	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

4	发展	02 月 03 日		股票						
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	锁定期股票	33.49	33.93	63	2,109.87	2,137.59	—
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	98	1,544.48	4,577.58	—
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	17.70	84.32	220	3,894.00	18,550.40	—
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	112	4,589.76	34,517.28	—
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	1,458	25,544.16	52,371.36	—
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	锁定期股票	22.68	42.16	3,236	73,392.48	136,429.76	—
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	锁定期股票	92.18	463.15	90	8,296.20	41,683.50	—
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	44.56	468.67	136	6,060.16	63,739.12	—
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	锁定期股票	81.88	1,584.33	86	7,041.68	136,252.38	—
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	144	8,056.80	8,222.40	—

		日								
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	9.47	70.14	1,046	9,905.62	73,366.44	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	锁定期股票	19.68	141.49	489	9,623.52	69,188.61	-

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
111025	圣泉转债	2026 年 06 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	610	61,000.00	61,000.80	-
113704	春风转债	2026 年 06 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	460	46,000.00	46,002.12	-
118071	华峰转债	2026 年 06 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	160	16,000.00	16,000.28	-

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	123,003.20	34,000.52
未评级	—	—
合计	123,003.20	34,000.52

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

进行监控, 以及定期开展压力测试等方式防范流动性风险。

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

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合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。

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	21,623,645.68	-	-	-	-	-	21,623,645.68
结算备付金	10,991.24	-	-	-	-	-	10,991.24
存出保证金	9,934.57	-	-	-	-	-	9,934.57
交易性金融资产	-	-	-	-	123,003.20	343,671,016.31	343,794,019.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	43,240.85	43,240.85
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	207,438.05	207,438.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,644,571.49	-	-	-	123,003.20	343,921,695.21	365,689,269.90
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	-	-	-	-	-	491,558.82	491,558.82
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,450,099.77	1,450,099.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	280,973.75	280,973.75
应付托管费	-	-	-	-	-	56,194.74	56,194.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,176.32	44,176.32
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.02	0.02
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	95,174.84	95,174.84
负债总计	-	-	-	-	-	2,418,178.26	2,418,178.26
利率敏感度缺口	21,644,571.49	-	-	-	123,003.20	341,503,516.95	363,271,091.64
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	19,256,306.84	-	-	-	-	-	19,256,306.84
结算备付金	99,489.04	-	-	-	-	-	99,489.04
存出保证金	13,037.75	-	-	-	-	-	13,037.75
交易性金融资产	-	-	-	-	34,000.52	305,878,410.57	305,912,411.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	130,916.43	130,916.43
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	226,464.96	226,464.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,368,833.63	-	-	-	34,000.52	306,235,791.96	325,638,626.11
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	-	-	-	-	-	652.63	652.63
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,654,706.80	1,654,706.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	268,253.22	268,253.22
应付托管费	-	-	-	-	-	53,650.67	53,650.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,455.81	5,455.81
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	-	-	-	-	-	188,711.49	188,711.49
负债总计	-	-	-	-	-	2,171,430.62	2,171,430.62
利率敏感度缺口	19,368,833.63	-	-	-	34,000.52	304,064,361.34	323,467,195.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本报告期末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	343,671,016.31	94.60	305,878,410.57	94.56
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	123,003.20	0.03	—	—
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	343,794,019.51	94.63	305,878,410.57	94.56

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2026 年 06 月 30 日)	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	17,110,193.87	14,909,285.58
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-17,110,193.87	-14,909,285.58

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	342,445,683.18	305,030,189.44
第二层次	123,003.20	34,000.52
第三层次	1,225,333.13	848,221.13
合计	343,794,019.51	305,912,411.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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	343,671,016.31	93.98
	其中：股票	343,671,016.31	93.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,003.20	0.03
	其中：债券	123,003.20	0.03
	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	21,634,636.92	5.92
8	其他各项资产	260,613.47	0.07
9	合计	365,689,269.90	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	1,122,755.08	0.31
B	采矿业	10,575,922.40	2.91
C	制造业	257,553,546.11	70.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,339,518.40	2.30
E	建筑业	2,018,327.00	0.56
F	批发和零售业	6,501,683.88	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	4,164,239.00	1.15
H	住宿和餐饮业	246,463.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,118,700.93	6.09
J	金融业	18,813,092.44	5.18
K	房地产业	1,379,717.00	0.38
L	租赁和商务服务业	3,508,722.80	0.97
M	科学研究和技术服务业	2,501,494.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	1,188,217.60	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	808,607.52	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,610,480.72	0.44
S	综合	-	-
	合计	342,451,487.88	94.27

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	29,264.14	0.01
C	制造业	1,188,680.83	0.33
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	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
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	1,219,528.43	0.34

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	688498	源杰科技	3,000	5,658,000.00	1.56
2	300604	长川科技	13,500	4,609,170.00	1.27
3	001309	德明利	4,800	4,525,920.00	1.25
4	688347	华虹宏力	12,500	4,203,750.00	1.16
5	688120	华海清科	12,039	3,878,725.02	1.07
6	002281	光迅科技	14,700	3,777,018.00	1.04
7	002008	大族激光	25,100	3,767,761.00	1.04
8	300857	协创数据	10,460	3,555,354.00	0.98
9	300136	信维通信	29,400	3,505,950.00	0.97

10	688361	中科飞测	7,500	3,225,000.00	0.89
11	300475	香农芯创	10,000	3,000,000.00	0.83
12	300223	君正股份	11,800	2,937,020.00	0.81
13	002436	兴森科技	51,700	2,634,115.00	0.73
14	300285	国瓷材料	24,300	2,507,274.00	0.69
15	300054	鼎龙股份	23,200	2,458,504.00	0.68
16	600105	永鼎股份	35,600	2,402,288.00	0.66
17	300666	江丰电子	6,500	2,395,900.00	0.66
18	688200	华峰测控	4,300	2,257,930.00	0.62
19	688777	中控技术	19,200	2,256,000.00	0.62
20	300757	罗博特科	3,600	2,228,400.00	0.61
21	000021	深科技	33,500	2,153,045.00	0.59
22	688037	芯源微	4,900	2,151,345.00	0.59
23	002851	麦格米特	12,400	2,073,032.00	0.57
24	601869	长飞光纤	3,700	2,019,830.00	0.56
25	300548	长芯博创	7,200	2,001,600.00	0.55
26	002409	雅克科技	8,700	1,953,150.00	0.54
27	300346	南大光电	21,000	1,945,650.00	0.54
28	300567	精测电子	6,000	1,905,600.00	0.52
29	688019	安集科技	5,510	1,870,424.60	0.51
30	600498	烽火通信	24,800	1,825,280.00	0.50
31	002407	多氟多	36,100	1,813,303.00	0.50
32	002185	华天科技	80,700	1,800,417.00	0.50
33	688313	仕佳光子	9,700	1,791,105.00	0.49
34	002138	顺络电子	24,500	1,790,950.00	0.49
35	688002	睿创微纳	11,466	1,773,675.54	0.49
36	300395	菲利华	12,800	1,711,744.00	0.47
37	600879	航天电子	80,100	1,705,329.00	0.47
38	300620	光库科技	4,500	1,701,900.00	0.47
39	300390	天华新能	17,700	1,655,127.00	0.46
40	688017	绿的谐波	3,900	1,629,654.00	0.45
41	688469	芯联集成	152,700	1,620,147.00	0.45
42	301526	国际复材	34,300	1,600,781.00	0.44
43	300373	扬杰科技	9,900	1,556,577.00	0.43
44	300058	蓝色光标	108,980	1,499,564.80	0.41
45	002273	水晶光电	42,240	1,498,675.20	0.41
46	300037	新宙邦	16,100	1,494,885.00	0.41
47	603256	宏和科技	5,500	1,459,315.00	0.40
48	688172	燕东微	17,400	1,455,684.00	0.40
49	688702	盛科通信	3,700	1,442,963.00	0.40
50	300751	迈为股份	5,100	1,440,546.00	0.40

51	605358	立昂微	18,000	1,396,800.00	0.38
52	301377	鼎泰高科	2,500	1,377,250.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	50,500	1,329,160.00	0.37
54	688099	晶晨股份	12,886	1,325,969.40	0.37
55	605589	圣泉集团	20,600	1,309,542.00	0.36
56	600885	宏发股份	37,588	1,296,410.12	0.36
57	002738	中矿资源	21,940	1,294,240.60	0.36
58	002126	银轮股份	25,700	1,279,860.00	0.35
59	000960	锡业股份	29,956	1,278,821.64	0.35
60	600392	盛和资源	42,600	1,268,202.00	0.35
61	600601	方正科技	90,800	1,256,672.00	0.35
62	000831	中国稀土	22,600	1,254,074.00	0.35
63	001389	广合科技	5,200	1,233,700.00	0.34
64	600141	兴发集团	25,500	1,197,735.00	0.33
65	002812	恩捷股份	17,900	1,197,689.00	0.33
66	300570	太辰光	4,800	1,184,208.00	0.33
67	600378	昊华科技	15,700	1,183,466.00	0.33
68	301358	湖南裕能	15,400	1,168,398.00	0.32
69	601179	中国西电	77,800	1,160,776.00	0.32
70	688234	天岳先进	6,500	1,127,815.00	0.31
71	002195	岩山科技	172,160	1,125,926.40	0.31
72	002850	科达利	5,900	1,116,870.00	0.31
73	600497	驰宏锌锗	91,800	1,111,698.00	0.31
74	002261	拓维信息	38,200	1,069,982.00	0.29
75	688629	华丰科技	5,700	1,068,807.00	0.29
76	600157	永泰能源	662,300	1,066,303.00	0.29
77	600711	盛屯矿业	93,800	1,028,986.00	0.28
78	002340	格林美	154,900	1,023,889.00	0.28
79	600909	华安证券	91,980	1,021,897.80	0.28
80	688027	国盾量子	2,000	1,008,020.00	0.28
81	600143	金发科技	64,900	1,002,705.00	0.28
82	003031	中瓷电子	5,500	991,650.00	0.27
83	002821	凯莱英	6,100	988,200.00	0.27
84	300017	网宿科技	75,800	986,158.00	0.27
85	000783	长江证券	100,700	981,825.00	0.27
86	688052	纳芯微	3,401	980,542.31	0.27
87	002131	利欧股份	205,600	976,600.00	0.27
88	688411	海博思创	3,300	960,960.00	0.26
89	688220	翱捷科技	7,700	957,264.00	0.26
90	600352	浙江龙盛	79,000	956,690.00	0.26
91	601555	东吴证券	120,630	955,389.60	0.26

92	301611	珂玛科技	5,300	954,371.00	0.26
93	002203	海亮股份	41,700	952,845.00	0.26
94	002966	苏州银行	135,730	944,680.80	0.26
95	301200	大族数控	2,600	937,690.00	0.26
96	601233	桐昆股份	43,300	937,445.00	0.26
97	603659	璞泰来	32,400	937,332.00	0.26
98	300339	润和软件	24,300	935,793.00	0.26
99	688235	百济神州	3,600	916,596.00	0.25
100	300759	康龙化成	31,600	914,188.00	0.25
101	688213	思特威	8,500	910,095.00	0.25
102	688578	艾力斯	8,200	895,440.00	0.25
103	603308	应流股份	14,500	875,800.00	0.24
104	002472	双环传动	20,700	859,257.00	0.24
105	601108	财通证券	99,200	858,080.00	0.24
106	300207	欣旺达	44,900	852,651.00	0.23
107	002517	恺英网络	52,200	848,250.00	0.23
108	300001	特锐德	22,400	847,392.00	0.23
109	603129	春风动力	3,300	844,140.00	0.23
110	002797	第一创业	128,200	842,274.00	0.23
111	002601	龙佰集团	50,900	838,832.00	0.23
112	300458	全志科技	21,160	834,973.60	0.23
113	601958	金钼股份	29,500	829,245.00	0.23
114	688387	信科移动	41,500	823,360.00	0.23
115	688385	复旦微电	11,500	819,835.00	0.23
116	300115	长盈精密	28,800	804,672.00	0.22
117	601198	东兴证券	59,200	804,528.00	0.22
118	601991	大唐发电	112,900	799,332.00	0.22
119	688322	奥比中光	6,100	796,355.00	0.22
120	002155	湖南黄金	33,200	792,484.00	0.22
121	000703	恒逸石化	58,300	791,131.00	0.22
122	688301	奕瑞科技	6,358	788,392.00	0.22
123	600563	法拉电子	4,100	782,280.00	0.22
124	002465	海格通信	60,300	770,031.00	0.21
125	603179	新泉股份	15,320	760,638.00	0.21
126	300454	深信服	7,900	759,980.00	0.21
127	601665	齐鲁银行	131,400	758,178.00	0.21
128	002056	横店东磁	24,700	752,856.00	0.21
129	603156	养元饮品	15,300	750,771.00	0.21
130	600884	杉杉股份	54,900	743,895.00	0.20
131	600707	彩虹股份	43,800	739,782.00	0.20
132	300024	机器人	38,200	738,406.00	0.20

133	603650	彤程新材	7,500	734,850.00	0.20
134	601162	天风证券	215,200	725,224.00	0.20
135	002130	沃尔核材	38,200	724,272.00	0.20
136	002402	和而泰	28,000	723,240.00	0.20
137	000060	中金岭南	94,900	718,393.00	0.20
138	002429	兆驰股份	69,100	717,949.00	0.20
139	300012	华测检测	51,400	712,404.00	0.20
140	688676	金盘科技	8,400	710,976.00	0.20
141	000878	云南铜业	44,400	705,072.00	0.19
142	688331	荣昌生物	5,400	703,404.00	0.19
143	603379	三美股份	9,240	701,223.60	0.19
144	002432	九安医疗	9,900	699,732.00	0.19
145	601099	太平洋	206,900	697,253.00	0.19
146	600109	国金证券	79,100	694,498.00	0.19
147	300496	中科创达	11,200	692,048.00	0.19
148	000893	亚钾国际	16,900	691,041.00	0.19
149	000034	神州数码	24,820	688,755.00	0.19
150	002271	东方雨虹	58,000	688,460.00	0.19
151	300623	捷捷微电	15,300	688,347.00	0.19
152	002414	高德红外	51,900	688,194.00	0.19
153	603688	石英股份	8,250	681,532.50	0.19
154	002444	巨星科技	21,900	681,090.00	0.19
155	002335	科华数据	16,005	679,412.25	0.19
156	689009	九号公司	17,805	679,260.75	0.19
157	600256	广汇能源	136,600	674,804.00	0.19
158	300474	景嘉微	11,150	674,352.00	0.19
159	603979	金诚信	11,400	672,942.00	0.19
160	002487	大金重工	11,600	672,452.00	0.19
161	600298	安琪酵母	18,500	669,700.00	0.18
162	000733	振华科技	11,800	668,352.00	0.18
163	688728	格科微	31,700	666,968.00	0.18
164	688266	泽璟制药	5,700	664,962.00	0.18
165	600060	海信视像	23,800	663,306.00	0.18
166	300763	锦浪科技	7,300	659,555.00	0.18
167	000661	长春高新	9,900	659,340.00	0.18
168	301536	星宸科技	5,100	656,421.00	0.18
169	002756	永兴材料	11,500	651,360.00	0.18
170	601128	常熟银行	111,237	647,399.34	0.18
171	600021	上海电力	42,800	644,996.00	0.18
172	300748	金力永磁	20,860	643,531.00	0.18
173	600699	均胜电子	29,660	640,952.60	0.18

174	601696	中银证券	50,600	640,090.00	0.18
175	002078	太阳纸业	51,200	639,488.00	0.18
176	601577	长沙银行	73,200	637,572.00	0.18
177	601615	明阳智能	54,900	635,193.00	0.17
178	002157	正邦科技	225,700	634,217.00	0.17
179	300073	当升科技	13,200	634,128.00	0.17
180	300142	沃森生物	48,800	633,912.00	0.17
181	002025	航天电器	8,300	632,626.00	0.17
182	603920	世运电路	13,100	629,324.00	0.17
183	688343	云天励飞	7,700	628,782.00	0.17
184	300432	富临精工	31,200	626,808.00	0.17
185	603606	东方电缆	15,080	625,970.80	0.17
186	000423	东阿阿胶	13,800	625,968.00	0.17
187	300919	中伟新材	14,200	621,250.00	0.17
188	603087	甘李药业	10,900	618,684.00	0.17
189	002252	上海莱士	140,800	611,072.00	0.17
190	688599	天合光能	42,900	605,748.00	0.17
191	300724	捷佳伟创	8,500	600,100.00	0.17
192	688169	石头科技	6,300	598,311.00	0.16
193	000728	国元证券	79,500	595,455.00	0.16
194	688608	恒玄科技	3,520	588,508.80	0.16
195	300953	震裕科技	4,400	588,280.00	0.16
196	688375	国博电子	5,518	575,527.40	0.16
197	002064	华峰化学	60,300	572,247.00	0.16
198	603119	浙江荣泰	8,600	570,524.00	0.16
199	000786	北新建材	31,200	564,408.00	0.16
200	001203	大中矿业	18,700	560,065.00	0.15
201	002831	裕同科技	15,729	559,323.24	0.15
202	688018	乐鑫科技	4,340	555,172.80	0.15
203	600171	上海贝岭	17,300	552,562.00	0.15
204	688180	君实生物	16,300	551,266.00	0.15
205	603290	斯达半导	3,600	550,584.00	0.15
206	688187	时代电气	8,000	549,280.00	0.15
207	300383	光环新网	43,900	546,116.00	0.15
208	300677	英科医疗	13,900	544,463.00	0.15
209	300679	电连技术	9,000	539,910.00	0.15
210	000519	中兵红箭	25,600	539,392.00	0.15
211	002673	西部证券	82,100	532,829.00	0.15
212	603806	福斯特	31,700	532,243.00	0.15
213	600177	雅戈尔	70,500	530,865.00	0.15
214	600516	方大炭素	85,900	530,003.00	0.15

215	688065	凯赛生物	11,000	526,350.00	0.14
216	000559	万向钱潮	40,600	524,958.00	0.14
217	603160	汇顶科技	8,500	524,535.00	0.14
218	601699	潞安环能	36,500	521,220.00	0.14
219	600642	申能股份	59,600	520,308.00	0.14
220	300972	万辰集团	3,000	520,230.00	0.14
221	000623	吉林敖东	29,100	515,943.00	0.14
222	688568	中科星图	12,400	514,228.00	0.14
223	002624	完美世界	41,400	514,188.00	0.14
224	688188	柏楚电子	4,809	513,120.30	0.14
225	600637	东方明珠	61,200	508,572.00	0.14
226	001696	宗申动力	24,400	507,764.00	0.14
227	300699	光威复材	17,680	506,532.00	0.14
228	000983	山西焦煤	86,600	502,280.00	0.14
229	000750	国海证券	136,350	501,768.00	0.14
230	603225	新凤鸣	25,500	501,075.00	0.14
231	300558	贝达药业	7,700	501,039.00	0.14
232	002085	万丰奥威	45,100	500,159.00	0.14
233	002318	久立特材	20,900	499,510.00	0.14
234	603345	安井食品	6,200	497,178.00	0.14
235	002739	儒意电影	51,600	495,360.00	0.14
236	002065	东华软件	68,700	490,518.00	0.14
237	600100	同方股份	71,600	490,460.00	0.14
238	600369	西南证券	121,600	488,832.00	0.13
239	002266	浙富控股	95,600	483,736.00	0.13
240	002044	美年健康	95,900	482,377.00	0.13
241	300627	华测导航	16,960	481,664.00	0.13
242	600499	科达制造	34,900	481,620.00	0.13
243	600595	中孚实业	85,600	481,072.00	0.13
244	688617	惠泰医疗	2,647	480,589.32	0.13
245	600536	中国软件	17,028	478,827.36	0.13
246	603596	伯特利	19,181	476,456.04	0.13
247	688772	珠海冠宇	24,200	475,046.00	0.13
248	603699	纽威股份	9,400	472,820.00	0.13
249	000629	钒钛股份	141,500	472,610.00	0.13
250	000155	川能动力	39,400	472,012.00	0.13
251	002223	鱼跃医疗	18,350	470,861.00	0.13
252	000400	许继电气	21,600	468,720.00	0.13
253	300002	神州泰岳	60,000	468,600.00	0.13
254	603444	吉比特	1,300	465,946.00	0.13
255	601016	节能风电	119,880	465,134.40	0.13

256	300003	乐普医疗	39,100	463,335.00	0.13
257	600862	中航高科	25,600	461,568.00	0.13
258	601216	君正集团	103,400	461,164.00	0.13
259	600985	淮北矿业	32,800	460,840.00	0.13
260	600521	华海药业	32,000	460,800.00	0.13
261	000032	深桑达 A	18,400	459,080.00	0.13
262	000683	博源化工	79,700	459,072.00	0.13
263	601717	中创智领	32,959	458,459.69	0.13
264	002430	杭氧股份	14,800	458,208.00	0.13
265	000415	渤海租赁	112,500	457,875.00	0.13
266	601997	贵阳银行	89,200	457,596.00	0.13
267	300487	蓝晓科技	7,750	456,087.50	0.13
268	000039	中集集团	55,870	453,105.70	0.12
269	600863	华能蒙电	96,000	451,200.00	0.12
270	603766	隆鑫通用	37,500	447,375.00	0.12
271	600704	物产中大	94,500	446,040.00	0.12
272	600873	梅花生物	60,100	441,735.00	0.12
273	601001	晋控煤业	25,400	441,706.00	0.12
274	000050	深天马 A	44,500	440,995.00	0.12
275	601990	南京证券	67,000	440,190.00	0.12
276	688538	和辉光电	169,123	439,719.80	0.12
277	002841	视源股份	12,700	438,531.00	0.12
278	600312	平高电气	24,800	437,968.00	0.12
279	000729	燕京啤酒	43,200	437,616.00	0.12
280	603077	和邦生物	187,400	434,768.00	0.12
281	000887	中鼎股份	24,200	432,938.00	0.12
282	000967	盈峰环境	41,000	431,730.00	0.12
283	603605	珀莱雅	7,200	431,424.00	0.12
284	600332	白云山	21,400	428,856.00	0.12
285	688297	中无人机	10,306	428,214.30	0.12
286	600765	中航重机	32,960	425,843.20	0.12
287	600166	福田汽车	145,000	421,950.00	0.12
288	600153	建发股份	53,100	421,083.00	0.12
289	600348	华阳股份	55,000	420,750.00	0.12
290	000830	鲁西化工	34,800	417,600.00	0.11
291	688692	达梦数据	1,700	415,293.00	0.11
292	002410	广联达	50,400	411,264.00	0.11
293	002939	长城证券	48,900	407,826.00	0.11
294	002007	华兰生物	33,400	407,146.00	0.11
295	601611	中国核建	36,500	406,975.00	0.11
296	600901	江苏金租	70,600	405,950.00	0.11

297	002683	广东宏大	13,800	404,202.00	0.11
298	000062	深圳华强	12,700	404,114.00	0.11
299	600737	中粮糖业	32,600	401,958.00	0.11
300	688615	合合信息	3,540	400,374.00	0.11
301	688582	芯动联科	6,100	396,500.00	0.11
302	600363	联创光电	11,000	393,580.00	0.11
303	688114	华大智造	7,700	393,316.00	0.11
304	600578	京能电力	60,900	392,805.00	0.11
305	603728	鸣志电器	6,400	389,888.00	0.11
306	002926	华西证券	47,700	389,709.00	0.11
307	601799	星宇股份	4,300	389,666.00	0.11
308	603568	伟明环保	25,120	386,345.60	0.11
309	000737	北方铜业	29,100	384,702.00	0.11
310	600398	海澜之家	73,300	383,359.00	0.11
311	000921	海信家电	14,000	382,480.00	0.11
312	000591	太阳能	83,100	382,260.00	0.11
313	002603	以岭药业	25,400	381,000.00	0.10
314	603298	杭叉集团	15,900	379,374.00	0.10
315	000528	柳 工	49,500	373,725.00	0.10
316	601000	唐山港	89,800	372,670.00	0.10
317	600486	扬农化工	7,350	372,645.00	0.10
318	600208	衢州发展	130,300	368,749.00	0.10
319	000738	航发控制	20,100	367,629.00	0.10
320	600316	洪都航空	13,100	366,014.00	0.10
321	603341	龙旗科技	8,600	365,414.00	0.10
322	000932	华菱钢铁	104,700	363,309.00	0.10
323	600008	首创环保	133,450	362,984.00	0.10
324	600435	北方导航	32,400	362,880.00	0.10
325	000987	越秀资本	46,115	360,619.30	0.10
326	688248	南网科技	5,200	359,736.00	0.10
327	600170	上海建工	161,600	358,752.00	0.10
328	600998	九州通	76,464	358,616.16	0.10
329	600995	南网储能	29,100	357,930.00	0.10
330	603486	科沃斯	7,000	355,250.00	0.10
331	002152	广电运通	37,800	354,564.00	0.10
332	000997	新 大 陆	21,600	352,080.00	0.10
333	600820	隧道股份	67,400	351,154.00	0.10
334	002262	恩华药业	18,700	350,625.00	0.10
335	600161	天坛生物	30,200	349,716.00	0.10
336	000951	中国重汽	17,900	349,229.00	0.10
337	600282	南钢股份	75,500	346,545.00	0.10

338	600483	福能股份	33,700	343,403.00	0.09
339	601106	中国一重	103,900	342,870.00	0.09
340	603885	吉祥航空	33,300	342,657.00	0.09
341	000009	中国宝安	55,000	342,650.00	0.09
342	600583	海油工程	67,000	337,010.00	0.09
343	002500	山西证券	65,310	336,999.60	0.09
344	603816	顾家家居	14,900	333,164.00	0.09
345	688778	厦钨新能	6,120	332,928.00	0.09
346	603939	益丰药房	18,364	330,184.72	0.09
347	000582	北部湾港	30,700	329,411.00	0.09
348	600546	山煤国际	30,000	327,900.00	0.09
349	603338	浙江鼎力	7,700	327,250.00	0.09
350	688295	中复神鹰	5,400	326,916.00	0.09
351	600763	通策医疗	9,629	326,230.52	0.09
352	688166	博瑞医药	9,300	325,593.00	0.09
353	600329	达仁堂	8,700	323,814.00	0.09
354	601666	平煤股份	45,100	322,465.00	0.09
355	600685	中船防务	12,600	320,544.00	0.09
356	003022	联泓新科	12,300	318,570.00	0.09
357	600562	国睿科技	15,000	318,300.00	0.09
358	601567	三星电气	21,200	316,728.00	0.09
359	300676	华大基因	9,000	315,540.00	0.09
360	002312	川发龙蟒	34,400	315,448.00	0.09
361	688318	财富趋势	4,420	315,190.20	0.09
362	601156	东航物流	19,500	314,340.00	0.09
363	000723	美锦能源	93,800	314,230.00	0.09
364	603565	中谷物流	32,000	313,920.00	0.09
365	600380	健康元	33,300	313,686.00	0.09
366	600038	中直股份	12,400	313,596.00	0.09
367	600602	云赛智联	19,500	313,560.00	0.09
368	600390	五矿资本	68,200	310,992.00	0.09
369	000513	丽珠集团	10,750	310,567.50	0.09
370	601880	辽港股份	223,200	308,016.00	0.08
371	600132	重庆啤酒	7,400	305,620.00	0.08
372	601399	国机重装	87,100	304,850.00	0.08
373	601865	福莱特	29,000	304,790.00	0.08
374	600535	天士力	22,800	301,644.00	0.08
375	600511	国药股份	11,500	299,460.00	0.08
376	600906	财达证券	39,800	296,908.00	0.08
377	600977	中国电影	22,900	295,868.00	0.08
378	601236	红塔证券	43,200	294,624.00	0.08

379	000739	普洛药业	17,482	291,250.12	0.08
380	000598	兴蓉环境	45,200	290,184.00	0.08
381	600816	建元信托	118,800	289,872.00	0.08
382	300100	双林股份	10,400	288,912.00	0.08
383	688281	华秦科技	5,751	288,872.73	0.08
384	002244	滨江集团	37,900	288,040.00	0.08
385	002299	圣农发展	18,900	286,524.00	0.08
386	600970	中材国际	40,100	285,913.00	0.08
387	688336	三生国健	5,365	284,881.50	0.08
388	601155	新城控股	27,500	282,150.00	0.08
389	600967	内蒙一机	25,800	279,930.00	0.08
390	300735	光弘科技	12,300	279,702.00	0.08
391	002120	韵达股份	43,900	279,204.00	0.08
392	300144	宋城演艺	47,700	277,137.00	0.08
393	000883	湖北能源	64,100	276,912.00	0.08
394	300146	汤臣倍健	30,600	276,624.00	0.08
395	300718	长盛轴承	4,500	274,365.00	0.08
396	688278	特宝生物	5,000	272,000.00	0.07
397	000800	一汽解放	45,100	268,345.00	0.07
398	002568	百润股份	15,800	267,336.00	0.07
399	000027	深圳能源	43,100	267,220.00	0.07
400	600131	国网信通	18,200	265,720.00	0.07
401	688363	华熙生物	7,400	264,698.00	0.07
402	603737	三棵树	10,870	261,967.00	0.07
403	601866	中远海发	118,200	261,222.00	0.07
404	600095	湘财股份	34,500	259,785.00	0.07
405	000088	盐田港	63,000	257,670.00	0.07
406	600801	华新建材	16,460	256,776.00	0.07
407	601118	海南橡胶	51,900	255,348.00	0.07
408	002583	海能达	33,100	254,539.00	0.07
409	003021	兆威机电	2,900	253,315.00	0.07
410	600126	杭钢股份	41,300	253,169.00	0.07
411	600871	石化油服	123,200	250,096.00	0.07
412	002984	森麒麟	19,100	249,637.00	0.07
413	600566	济川药业	11,200	248,528.00	0.07
414	603000	人民网	16,700	246,993.00	0.07
415	600754	锦江酒店	13,700	246,463.00	0.07
416	600655	豫园股份	59,700	245,367.00	0.07
417	600517	国网英大	52,300	244,764.00	0.07
418	000709	河钢股份	124,700	241,918.00	0.07
419	603589	口子窖	12,800	239,104.00	0.07

420	000825	太钢不锈	68,700	234,267.00	0.06
421	603858	步长制药	16,000	233,600.00	0.06
422	600598	北大荒	21,512	233,190.08	0.06
423	301606	绿联科技	3,800	231,876.00	0.06
424	601598	中国外运	46,700	231,632.00	0.06
425	600350	山东高速	20,700	230,391.00	0.06
426	002423	中粮资本	27,900	229,617.00	0.06
427	001286	陕西能源	22,600	229,164.00	0.06
428	603899	晨光股份	11,100	228,993.00	0.06
429	600004	白云机场	31,400	227,964.00	0.06
430	688192	迪哲医药	5,700	227,601.00	0.06
431	002773	康弘药业	11,100	226,995.00	0.06
432	601966	玲珑轮胎	22,100	225,199.00	0.06
433	688709	成都华微	5,900	224,731.00	0.06
434	600663	陆家嘴	35,600	223,568.00	0.06
435	600582	天地科技	49,900	222,055.00	0.06
436	688349	三一重能	14,560	221,020.80	0.06
437	600848	上海临港	29,000	217,210.00	0.06
438	000429	粤高速 A	15,900	217,035.00	0.06
439	601098	中南传媒	21,808	214,590.72	0.06
440	002508	老板电器	14,500	211,990.00	0.06
441	688563	航材股份	4,100	210,043.00	0.06
442	603233	大参林	13,900	208,917.00	0.06
443	601928	凤凰传媒	23,500	206,565.00	0.06
444	600968	海油发展	61,900	206,127.00	0.06
445	600062	华润双鹤	12,600	202,104.00	0.06
446	300957	贝泰妮	6,400	201,664.00	0.06
447	003035	南网能源	34,300	199,626.00	0.05
448	688561	奇安信	8,300	199,034.00	0.05
449	300888	稳健医疗	7,080	198,169.20	0.05
450	600688	上海石化	67,000	196,310.00	0.05
451	688425	铁建重工	48,700	195,774.00	0.05
452	601808	中海油服	18,100	195,661.00	0.05
453	002032	苏泊尔	4,900	194,040.00	0.05
454	002670	国盛证券	17,600	193,600.00	0.05
455	600295	鄂尔多斯	18,000	192,960.00	0.05
456	688708	佳驰科技	3,700	187,960.00	0.05
457	600098	广州发展	31,700	187,347.00	0.05
458	000539	粤电力 A	27,300	185,913.00	0.05
459	600808	马钢股份	73,200	183,000.00	0.05
460	000537	绿发电力	24,900	182,019.00	0.05

461	002153	石基信息	25,092	181,415.16	0.05
462	600292	电投水电	14,700	176,988.00	0.05
463	600377	宁沪高速	15,100	174,707.00	0.05
464	601298	青岛港	21,400	172,270.00	0.05
465	603833	欧派家居	5,600	168,616.00	0.05
466	000959	首钢股份	46,967	164,854.17	0.05
467	301301	川宁生物	20,600	163,564.00	0.05
468	002265	建设工业	9,400	163,560.00	0.05
469	002608	江苏国信	23,000	158,700.00	0.04
470	600339	中油工程	51,000	156,570.00	0.04
471	600606	绿地控股	129,300	156,453.00	0.04
472	603529	爱玛科技	8,000	156,080.00	0.04
473	600032	浙江新能	22,000	155,100.00	0.04
474	603658	安图生物	5,300	153,806.00	0.04
475	000785	居然智家	76,800	153,600.00	0.04
476	600764	中国海防	8,800	153,384.00	0.04
477	603786	科博达	3,700	151,367.00	0.04
478	601139	深圳燃气	26,200	148,292.00	0.04
479	301498	乖宝宠物	3,600	146,124.00	0.04
480	688520	神州细胞	4,248	145,324.08	0.04
481	000937	冀中能源	35,530	141,409.40	0.04
482	300140	节能环保	28,400	141,148.00	0.04
483	000898	鞍钢股份	72,700	135,949.00	0.04
484	603175	超颖电子	1,500	133,635.00	0.04
485	688475	萤石网络	4,870	133,194.50	0.04
486	601228	广州港	46,500	131,130.00	0.04
487	603049	中策橡胶	2,900	129,949.00	0.04
488	601019	山东出版	18,900	120,960.00	0.03
489	002945	华林证券	8,400	112,812.00	0.03
490	601112	振石股份	6,130	111,538.70	0.03
491	600927	永安期货	8,900	110,805.00	0.03
492	002461	珠江啤酒	13,500	102,195.00	0.03
493	600299	安迪苏	12,300	96,555.00	0.03
494	688819	天能股份	4,100	91,020.00	0.03
495	603092	德力佳	1,100	59,367.00	0.02
496	001386	马可波罗	3,300	46,728.00	0.01
497	001221	悍高集团	1,100	44,242.00	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	301666	大普微	514	238,151.62	0.07
2	688781	视涯科技	3,236	136,429.76	0.04
3	688808	联讯仪器	86	136,252.38	0.04
4	688818	电科蓝天	1,046	73,366.44	0.02
5	688820	盛合晶微	489	69,188.61	0.02
6	688797	臻宝科技	136	63,739.12	0.02
7	301682	宏明电子	332	53,139.92	0.01
8	688712	北芯生命	1,458	52,371.36	0.01
9	001399	惠科股份	1,823	50,551.79	0.01
10	688785	恒运昌	90	41,683.50	0.01
11	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
12	688635	长进光子	112	34,517.28	0.01
13	001257	盛龙股份	1,411	29,264.14	0.01
14	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
15	603459	红板科技	220	18,550.40	0.01
16	301696	三瑞智能	213	18,488.40	0.01
17	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
18	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
19	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
20	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
21	301680	固德电材	115	12,898.40	0.00
22	001365	天海电子	372	11,647.32	0.00
23	001393	维通利	263	10,254.37	0.00
24	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
25	001237	惠康科技	150	8,811.00	0.00
26	688816	易思维	144	8,222.40	0.00
27	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
28	603435	嘉德利	98	4,577.58	0.00
29	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
30	603293	埃泰克	63	2,137.59	0.00
31	001312	福恩股份	123	2,063.94	0.00
32	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
33	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	688498	源杰科技	4,238,207.63	1.31
2	001309	德明利	3,100,761.00	0.96

3	300475	香农芯创	1,932,439.00	0.60
4	600105	永鼎股份	1,891,437.00	0.58
5	300548	长芯博创	1,878,645.00	0.58
6	300666	江丰电子	1,876,641.82	0.58
7	601869	长飞光纤	1,635,136.00	0.51
8	688313	仕佳光子	1,545,414.84	0.48
9	300620	光库科技	1,473,932.00	0.46
10	002407	多氟多	1,417,984.00	0.44
11	688200	华峰测控	1,319,919.52	0.41
12	301377	鼎泰高科	1,302,524.00	0.40
13	600711	盛屯矿业	1,269,385.00	0.39
14	603256	宏和科技	1,230,716.00	0.38
15	002812	恩捷股份	1,215,235.00	0.38
16	301526	国际复材	1,156,954.00	0.36
17	688037	芯源微	990,137.86	0.31
18	603308	应流股份	896,822.00	0.28
19	688411	海博思创	862,078.71	0.27
20	600256	广汇能源	829,460.00	0.26

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	600487	亨通光电	6,083,214.00	1.88
2	688525	佰维存储	3,455,327.35	1.07
3	002353	杰瑞股份	2,989,826.00	0.92
4	301308	江波龙	2,783,909.00	0.86
5	600549	厦门钨业	2,502,380.00	0.77
6	000657	中钨高新	2,407,094.30	0.74
7	002156	通富微电	2,380,782.00	0.74
8	000426	兴业银锡	1,856,663.00	0.57
9	601168	西部矿业	1,784,227.00	0.55
10	002837	英维克	1,752,258.50	0.54
11	002202	金风科技	1,725,096.00	0.53
12	600673	东阳光	1,611,291.00	0.50
13	300450	先导智能	1,562,584.00	0.48
14	600118	中国卫星	1,506,791.00	0.47
15	002080	中材科技	1,466,187.00	0.45
16	000933	神火股份	1,409,209.00	0.44
17	600096	云天化	1,294,104.00	0.40

18	600580	卧龙电驱	1,289,105.60	0.40
19	002532	天山铝业	1,266,530.00	0.39
20	603228	景旺电子	1,252,883.96	0.39

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	55,260,215.45
卖出股票收入（成交）总额	85,815,583.78

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）	123,003.20	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,003.20	0.03

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	111025	圣泉转债	610	61,000.80	0.02
2	113704	春风转债	460	46,002.12	0.01
3	118071	华峰转债	160	16,000.28	0.00

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	9,934.57
2	应收清算款	43,240.85

3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	207,438.05
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	260,613.47

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	301666	大普微	238,151.62	0.07	锁定期股票
2	688781	视涯科技	136,429.76	0.04	锁定期股票
3	688808	联讯仪器	136,252.38	0.04	锁定期股票
4	688818	电科蓝天	73,366.44	0.02	锁定期股票
5	688820	盛合晶微	69,188.61	0.02	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	22,762	3,829.77	14,451,772.73	16.58%	72,721,554.13	83.42%

中信保诚 中证 500 指 数（LOF）C	1,537	37,726.47	53,188,105.6 6	91.73%	4,797,476.22	8.27%
合计	24,299	5,973.86	67,639,878.3 9	46.60%	77,519,030.35	53.40%

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 500 指数（LOF） A	6,990.91	0.01%
	中信保诚中证 500 指数（LOF） C	3,207.79	0.01%
	合计	10,198.70	0.01%

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 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、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。
2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 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	98,561,099.99	59,080,858.92
本报告期基金总申购份额	11,367,212.84	8,014,644.48
减：本报告期基金总赎回份额	22,754,985.97	9,109,921.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	87,173,326.86	57,985,581.88

§ 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，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
财通证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东方财富 证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
国联民生 证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通 证券	3	—	—	—	—	—
国投证券	3	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	—	—	—
华福证券	1	—	—	—	—	—
华金证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	3	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—

开源证券	1	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源 证券	5	69,618,597.72	49.94%	13,639.77	49.94%	—
太平洋证 券	1	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
兴业证券	2	69,799,541.93	50.06%	13,673.62	50.06%	—
野村东方 国际	1	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中国银河 证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
中信建投 证券	2	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
中银国际 证券	2	—	—	—	—	—

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 债券回 购成交 总额的	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

				比例				
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民 生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	9,100.00	3.24%	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	253,889. 61	90.33%	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	18,090.5 3	6.44%	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司

开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）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 500 指数型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	同上	2026年01月23日
3	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	2026年01月26日
4	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	2026年01月26日
5	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）更新招募说明书	同上	2026年01月26日
6	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	同上	2026年03月30日
7	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	同上	2026年04月21日
8	关于中信保诚基金管理有限公司旗下部分基金修改托管协议的公告	同上	2026年04月25日
9	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）托管协议	同上	2026年04月25日
10	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	2026年05月29日
11	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	2026年05月29日
12	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01 至 2026-06-30	52,840,675.59	-	-	52,840,675.59	36.40%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致： (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2026 年 4 月 25 日披露的《关于中信保诚基金管理有限公司旗下部分基金修改托管协议的公告》，自 2026 年 4 月 25 日起修改本基金托管协议中清算相关条款。

§ 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。

中信保诚基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日