中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

蒙玺优优至臻中证 1000 指数量化 2 号 1 期私募证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

基金管理人：上海蒙玺投资管理有限公司

基金托管人：东方财富证券股份有限公司

报告基准日期：2026 年 9 月 30 日

中信中证印章（如有）
仅对本报告中的财务数据负责

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

§ 重要提示

基金管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担责任。

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，但不保证认（ 申 ）购资金本金不受损失 。

基金托管人东方财富证券股份有限公司复核了本报告中的基金财务情况等信息，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宣传推介材料和基金合同。

本报告中财务资料未经审计。除特别说明外，本报告中涉及金额的单位均为人民币元。

本报告期 2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日。

§1 基金产品概况

1.1 基金基本情况

项目	信息
基金名称	蒙玺优优至臻中证 1000 指数量化 2 号 1 期私募证券投资基金
基金编码	SBVE51
基金管理人	上海蒙玺投资管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金类型	私募证券投资基金
产品类型（选填）	权益类
组织形式	契约型
基金成立日期	2026 年 5 月 26 日
基金到期日期	2036 年 5 月 25 日
开放期安排（如有）	本基金的申购开放日为每周三，如遇非交易日，顺延至本周下一交易日，如本周无下一交易日的，则本周不开放。本基金的赎回开放日为每月第三个周三，如遇非交易日，则顺延至下一个周三，以此类推。如申购开放日与赎回开放日为同一天，则该日开放申购、赎回。
封闭期安排（如有）	产品无封闭期
份额锁定期安排（如有）	本基金设置份额锁定期，锁定期为自基金份额确认日起满 180 天（不含）（含基金管理人及其员工持有的基金份额（如有））。红利再投资所得份额不受份额锁定期的限制。
是否结构化分级	否
期末基金总份额	53,220,150.09
期末基金净资产	42,180,951.03

上海蒙玺投资管理有限公司
中信中证印章（如有）
仅对本报告中的财务数据负责

期末基金总资产	42,411,394.15
投资顾问（如有）	
基金经理（投资经理）	李骧
策略生成方式	量化投资
投资策略	指数增强策略
投资限制	1、以市值计算，本基金投资于“标的基金”的比例不低于基金净资产的 90%（含）（本条限制应当自本基金完成备案之日（不含）起 10 个工作日内符合）； 2、本基金总资产与净资产的比例不得超过 200%； 3、本基金投资于权益类资产的比例不低于基金已投资产 80%，本基金投资于其他私募资管产品（含私募证券投资基金）的，本条投资限制以季度为频率穿透合并计算监控； 4、本基金持有的 AA 级及以下信用债（不含可转债）及流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级，相关评级均不参考中债资信）； 5、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。
基金托管人	东方财富证券股份有限公司
基金估值服务机构	中信中证投资服务有限责任公司
基金份额登记机构	中信中证投资服务有限责任公司
财务数据是否经托管复核一致	是
财务数据托管复核情况说明	东方财富证券股份有限公司复核了基金本年度管理报告中的有关财务数据部分，内容真实、准确、完整。

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

1.2 基金管理人以及托管人基本情况

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海蒙玺投资管理有限公司	东方财富证券股份有限公司
统一社会信用代码		91310116MA1J86U820	--
法定代表人		李骧	--
信息披露负责人		李骧	刘潇蔓
信息披露联系人	姓名	廖阳	刘潇蔓
	联系电话	021-50800787	021-36532106
	电子邮箱	product@mxifund.com	jjtg_xxpl@18.cn
注册地址		上海市浦东新区中国（上海）自由贸易试验区临港新片区水芸路 89 号港城广场一街坊 13 号楼 1 层 105 室	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址		上海市浦东新区杨高南路 759	上海市静安区永和路 118 弄东

仅对本报告中的财务数据负责（如有）

	号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼（方林球企业中心 24 号楼 5 楼 26 楼	（基金托管部）

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

§2 基金业绩表现情况

2.1 基金净值及收益表现情况

阶段	当期	今年以来	自基金成立日起至今
份额净值		0.7926	
份额累计净值		0.7926	
基金收益率（%）	-20.68	-20.74	-20.74
业绩比较基准（如有）			
业绩比较基准收益率（%）（如有）			
基金最大回撤（%）		26.41	

分级基金净值及收益表现情况

-级基金净值及收益表现

阶段	当期	今年以来	自基金成立日起至今
份额净值		0.0000	
份额累计净值		0.0000	
基金收益率（%）	0.00	0.00	0.00
业绩比较基准（如有）			
业绩比较基准收益率（%）（如有）			
基金最大回撤（%）		0.00	

2.2 基金份额变动情况

	基金份额（份）
产品成立日	53,970,000.00
期初总额	54,220,150.09
加：当期增加	
减：当期减少	1,000,000.00
期末总额	53,220,150.09

分级基金份额变动情况

-级基金的份额变动

	基金份额（份）
产品成立日	
期初总额	
加：当期增加	
减：当期减少	
期末总额	

2.3 基金主要财务指标

项目	金额

中信中证印章（如有）仅对本报告中的财务数据负责

1.已实现收益	-402,966.02
其中：已扣除费用情况	230,468.12
（1）管理费	228,161.56
（2）业绩报酬	
（3）托管费	1,140.78
（4）销售服务费	0.00
（5）投资顾问费	0.00
（6）利息支出	0.00
（7）税金及附费	0.00
（8）其他费用	1,165.78
2.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-10,775,921.79
3.利润总额（损失以“-”填列）	-11,178,887.81
4.净利润（损失以“-”填列）	-11,178,887.81

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

§3 基金估值相关情况

本基金遵循公允性、一致性的原则，按照《企业会计准则》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《中国基金估值标准》等金融监管部门制定的基金估值相关业务规则办理基金资产估值。本基金托管人对管理人或其委托的行政服务机构编制的基金资产净值、基金份额净值等信息进行复核确认，并按约定的方式反馈复核结果。

§4 基金直接投资情况

4.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：1.股票	0.00	0.00
	2.新三板挂牌公司股票	0.00	0.00
	3.公开募集基础设施证券投资基金	0.00	0.00
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：1.债券	0.00	0.00
	2.资产支持证券	0.00	0.00
3	期货及衍生品	0.00	0.00
	其中：1.期货合约	0.00	0.00
	2.期权合约	0.00	0.00
	3.场外衍生品	0.00	0.00
4	资产管理产品	42,395,366.63	99.96
	其中：1.公募基金（不包括货币基金）	0.00	0.00
	2.信托计划	0.00	0.00
	3.银行理财产品	0.00	0.00

中信中证印章（如有）
仅对本报告的外包服务数据负责

	4. 保险资产管理产品	0.00	0.00
	5. 证券期货经营机构私募资产管理计划	0.00	0.00
	6. 私募基金	42,395,366.63	99.96
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款	16,027.52	0.04
8	结算备付金	0.00	0.00
9	境外投资	0.00	0.00
	其中：1. 股票	0.00	0.00
	2. 互联互通机制下投资的境外股票	0.00	0.00
	3. 债券	0.00	0.00
	4. 期货及衍生品	0.00	0.00
	5. 资产管理产品	0.00	0.00
	6. 其他	0.00	0.00
10	其他资产	0.00	0.00
	其中：1. 应收申购款	0.00	0.00
	2. 证券清算款	0.00	0.00
	3. 其他	0.00	0.00
合计		42,411,394.15	100.00

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

4.2 按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金净资产比例（%）
1	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	采矿业	0.00	0.00
3	制造业	0.00	0.00
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
5	建筑业	0.00	0.00
6	批发和零售业	0.00	0.00
7	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
8	住宿和餐饮业	0.00	0.00
9	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
10	金融业	0.00	0.00
11	房地产业	0.00	0.00
12	租赁和商务服务业	0.00	0.00
13	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
14	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
15	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
16	教育	0.00	0.00
17	卫生和社会工作	0.00	0.00
18	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
19	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

仅对本报告中的财务数据负责（如有）
中信中证投资

本基金本报告期末不涉及。

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

4.3 按行业分类的境外股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金净资产比例（%）
1	基础材料	0.00	0.00
2	消费者非必需品	0.00	0.00
3	消费者常用品	0.00	0.00
4	能源	0.00	0.00
5	金融	0.00	0.00
6	医疗保健	0.00	0.00
7	工业	0.00	0.00
8	信息技术	0.00	0.00
9	电信服务	0.00	0.00
10	公用事业	0.00	0.00
11	房地产	0.00	0.00
	合计		

本基金本报告期末不涉及。

4.4 按债券类型、评级分类的债券投资组合

序号	债券类型	公允价值	占基金净资产比例（%）
1	利率债		
2	信用债		
	合计		

本基金本报告期末不涉及。

4.5 场外衍生品持仓情况

序号	衍生品类型	挂钩标的资产类别	权利金	保证金	杠杆率（%）	期末合约市值	公允价值变动
合计							

本基金本报告期末不涉及。

4.6 投资资产管理产品策略分布情况

序号	投资策略	投资规模	占基金净资产比例（%）
1	指数增强策略	42,395,366.63	100.51
	合计	42,395,366.63	100.51

4.7 所投资产管理产品管理人情况

序号	管理人名称	管理人编码	投资产品数量	投资产品规模	投资产品规模占基金净资产比例（%）
1	上海蒙玺投资管理有限公司	P1063294	1	42,395,366.63	100.51

仅对本报告中的财务数据负责（如有）

4.8 标的基金情况

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

标的基金名称	投资规模	占基金净资产比例（%）
蒙玺优优至臻中证1000指数量化2号私募证券投资基金A类	42,395,366.63	100.51

§5 基金穿透投资情况

5.1 基金穿透投资资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资		
	其中：1.股票		
	2.新三板挂牌公司股票		
	3.公开募集基础设施证券投资基金		
2	固定收益投资		
	其中：1.债券		
	2.资产支持证券		
3	期货及衍生品		
	其中：1.期货合约		
	2.期权合约		
	3.场外衍生品		
4	公募基金（不包括货币基金）		
5	公募银行理财产品		
6	买入返售金融资产		
7	货币市场工具		
8	银行存款		
9	结算备付金		
10	境外投资		
	其中：1.股票		
	2.互联互通机制下投资的境外股票		
	3.债券		
	4.期货及衍生品		
	5.公募资产管理产品		
	6.其他		
11	其他资产		
	其中：1.应收申购款		
	2.证券清算款		
	3.其他		
合计			
投资路径说明			

本基金本报告期末百分之九十以上基金净资产投资于本管理人管理的单一私募基金，请参考“所投基金信披报告”。

仅对本报告中的财务数据负责（如有）

5.2 百分之九十以上基金净资产投资于本管理人管理的单一私募基金的，披露所投私募基金的信息披露报告。

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

§6 基金投资运作情况

6.1 高集中度持仓情况

序号	投资资产类型	投资资产数量	投资规模	占基金净资产比例（%）	后续拟处理方式

本基金本报告期末不涉及。

6.2 基金杠杆运用情况

期末基金总资产	期末基金净资产	期末杠杆率（%）	期初杠杆率（%）
42,411,394.15	42,180,951.03	100.55	100.19

若为分级基金，则需要披露以下表格

优先级份额	劣后级份额	期末分级杠杆率（%）	期初分级杠杆率（%）
		0.00	0.00

6.3 流动性受限资产投资情况

序号	受限类型	对应受限资产类别	期末成本总额	期末公允价值	公允价值占基金净资产比例（%）	具体估值方法说明	流动性受限情况说明

本基金本报告期末不涉及。

6.4 直接或者通过衍生品等间接方式投资境外资产情况

序号	跨境投资方式	境外资产交易场所所在国家或地区	是否直接投资	主要投资境外资产类别	投资规模	投资规模占基金净资产比例（%）	跨境投资路径及其他事项

本基金本报告期末不涉及。

§7 基金关联交易情况

7.1 基金关联方投资交易明细表

交易日期	关联交易类型	关联方名称	交易标的类型	交易对手方	交易方向	交易价格	关联交易金额	关联交易说明（包括但不限于履行基金合同约定的决策程序情况、价格确定依据）

中信中证印章（如有）仅对本报告中的财务数据负责

本基金本报告期内不涉及。

中信中证投资服务有限责任公司
基金业务外包服务信息披露专用章

7.2 私募基金特定关联交易汇总表

产品名称	当期净申赎金额	期末投资余额	关联交易说明 （包括但不限于履行基金合同约定的决策程序情况、价格确定依据）
蒙玺优优至臻中证 1000 指数量化 2 号私募证券投资基金 A 类	-902,400.00	42,395,366.63	

§8 基金主要投资风险、投资策略运行情况及其他事项

§9 附件目录

SBWL32_蒙玺优优至臻中证 1000 指数量化 2 号私募证券投资基金_2026-09-30_用印季报（管理人+行政外包用印版）.pdf

上海蒙玺投资管理有限公司

中信中证印章（如有）
仅对本报告中的财务数据负责